

EntryPoint

Sessão Supervisora

Roteiro de Certificação

Version: 1.1
Last modified:
30/08/2019

Contato

Trading Certification

- tradingcertification@b3.com.br
- +55 11 2565-5029

Sumário

1. Prefácio	5
2. Pré requisitos	6
A. Logon	7
B. Ordem Limitada DIA.....	8
C. Ordens com Instrumento Reservado	9
D. Registro de Ordens com Quantidade Aparente	10

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Autor
22 de Abril de 2014	1.0	- Criação do documento	AMS
29 de Agosto de 2019	1.1	- Correções nos cenários B e D.	Trading Certification

1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualificam uma instituição de terceiros conectar na B3 com o propósito de validar o funcionamento da Sessão Supervisora nos segmentos de Derivativos e Equities usando FIX 4.4 (Financial Information eXchange).

FIX é uma especificação técnica para comunicação eletrônica de mensagens relacionadas à negociação. É um padrão aberto gerenciado pelos membros do FIX Protocol Limited. (www.fixprotocol.org).

Este documento explicita o processo de certificação para cancelamento “on behalf” de ofertas enviadas por outras sessões (Mesa ou DMA) da B3 e é fornecido para terceiros que precisam de conectividade para negociação com a B3.

Para solicitar cópias deste documento, por favor contate: tradingcertification@b3.com.br

2. Pré requisitos

Os cenários de testes deverão ser executados sequencialmente.

Todas as mensagens FIX devem seguir a estrutura especificada no "EntryPoint: Interface de Envio de Ordens - Especificação de mensagens " e no " EntryPoint: Interface de Envio de Ordens - Regras" que estão disponíveis no site da B3: http://www.b3.com.br/pt_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-desenvolvedores-e-vendors/entrypoint-entrada-de-ofertas/.

A. Logon

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
A1.1	Cliente: Enviar Logon	Recebe a mensagem de Logon	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
A1.2	Aguardar Mensagem de Heartbeat	Recebe a mensagem de Heartbeat	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
A1.3	Cliente: Enviar o Logout	Recebe a mensagem de confirmação de Logout.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B. Ordem Limitada DIA

Disponível: Equities e Derivativos

OrderCancelRequest (35=F,41=<CLIENT OU ID A SER CANCELADO>,49=<SC SUPERVISORA>,448=<ENTERING TRADER>,448=<ENTERING FIRM>,448=<SENDER LOCATION = BVMF>,448=<OPERADOR ESPECIFICADO>,448=<SESSAO ORIGEM>,452=1001)

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B1.1	<p>Sessão DMA: Envia ordem de compra limitada, DIA</p> <p>Sessão Supervisora: Envia cancelamento da ordem de compra</p>	<p>Ordem é aceita</p> <p>Sessão DMA recebe o cancelamento da ordem de compra</p>	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.2	<p>Sessão DMA: Envia ordem de venda limitada, DIA</p> <p>Sessão Supervisora: Envia cancelamento da ordem de venda</p>	<p>Ordem é aceita</p> <p>Sessão DMA recebe o cancelamento da ordem de venda.</p>	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.3	<p>Sessão DMA: Envia ordem de compra limitada, DIA</p> <p>Sessão Supervisora: Envia cancelamento da ordem de compra sem o PartyId "EnteringTrader" (452=36)</p>	Cancelamento é rejeitado.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C. Ordens com Instrumento Reservado

Disponível: Equities e Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C1.1	<p>Trading Certification muda o estado do instrumento para Pre-Open (Reservado)</p> <p>Sessão DMA: Envia ordem de compra limitada, DIA 200@20</p> <p>Trading Certification: Envia ordem de venda limitada, DIA 200@20</p> <p>Sessão Supervisora: Envia cancelamento da ordem de compra</p>	<p>Ordem é aceita</p> <p>Ordem não pode ser cancelada</p>	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.2	<p>Sessão DMA: Envia ordem de compra limitada, DIA 200@21</p> <p>Sessão Supervisora: Envia cancelamento da ordem de compra anterior: 200@20</p>	<p>Ordem é aceita</p> <p>Sessão DMA recebe o cancelamento da ordem de compra.</p>	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.3	<p>Sessão DMA: Envia ordem de compra limitada, DIA 200@19</p> <p>Ordens no book: - compra: 200@21 - compra: 200@19 - venda: 200@20</p>	Ordem é aceita	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.4	<p>Trading Certification muda o estado do instrumento para Open</p> <p>Sessão Supervisora: Envia cancelamento da ordem de compra anterior: 200@19</p>	Sessão DMA recebe o cancelamento da ordem de compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

D. Registro de Ordens com Quantidade Aparente

Disponível: Equities e Derivativos

Tag: 111=<100>

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
D1.1	<p>Sessão DMA: Enviar ordem de compra limitada, DIA: - 10.000@20 com Quantidade Aparente: 100</p> <p>Trading Certification: Enviar ordem de venda limitada, DIA 100@20</p> <p>Sessão Supervisora: Enviar cancelamento da ordem de compra pendente</p>	<p>Execução Parcial da Ordem</p> <p>Sessão DMA recebe o Cancelamento da Ordem de Compra</p>	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D1.2	<p>Sessão DMA: Enviar ordem de venda limitada, GTD: - 10.000@20 com Quantidade Aparente: 100</p> <p>Trading Certification: Enviar ordem de compra limitada, DIA 100@20</p> <p>Sessão Supervisora: Enviar cancelamento da ordem de venda pendente</p>	<p>Execução Parcial da Ordem</p> <p>Sessão DMA recebe o cancelamento da ordem de venda.</p>	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D1.3	<p>Sessão DMA: Enviar ordem de compra limitada, GTC: - 10.000@20 com Quantidade Aparente: 100</p> <p>Sessão Supervisora: Enviar cancelamento da ordem de compra pendente</p>	<p>Ordem é aceita</p> <p>Sessão DMA recebe o cancelamento da ordem de compra.</p>	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E