



# Trademate Drop Copy

## Roteiro de Certificação

Version: 1.1  
Last modified: 08/11/2023

## Contato

Trading Certification

- [tradingcertification@b3.com.br](mailto:tradingcertification@b3.com.br)
- 55 11 2565-5023

## Índice

ÍNDICE .....	3
HISTÓRICO DE VERSÕES .....	4
- INCLUSÃO DO PASSO “H. LIMITAÇÃO DA MENSAGEM DE RETRANSMISSÃO” .....	ERRO!
INDICADOR NÃO DEFINIDO.	
1. PREFÁCIO .....	5
2. INTRODUÇÃO .....	6
PRÉ-REQUISITOS .....	6
A1. LOGON .....	7
A2. HEARTBEAT .....	7
A3. LOGOUT .....	7
A4. RESEND REQUEST .....	8
B. MENSAGEM DE MERCADO .....	9
C. DIRETO .....	ERRO! INDICADOR NÃO DEFINIDO.
D. H.A. – FALHA NA INSTÂNCIA PRINCIPAL DA APLICAÇÃO .....	10
E. LIMITAÇÃO DA MENSAGEM DE RETRANSMISSÃO .....	10

## Histórico de Versões

Data	Versão	Descrição	Autor
01 de Novembro de 2023	1.0	-Criação do roteiro.	Trading Certification
08 de Novembro de 2023	1.1	-Atualização do roteiro	ARUS

## 1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualifica uma instituição de terceiros conectar na B3 com o propósito de rotear ordens no segmento de Derivativos e Equities usando FIX4.4 (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](http://www.fixprotocol.org))

Este documento explicita o processo de certificação para rotear ordens através do EntryPoint da B3 e é fornecido para terceiros que precisam de conectividade para negociação com a B3.

Para requisitar cópias desse documento, favor contatar: [tradingcertification@b3.com.br](mailto:tradingcertification@b3.com.br)

## 2. Introdução

Os cenários de teste serão executados sequencialmente, e cada um estará disponível por 15 minutos, desta forma, os resultados esperados podem ser verificados e analisados inicialmente no caso de falha.

### Pré-requisitos

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 em: [http://www.b3.com.br/pt\\_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-desenvolvedores-e-vendors/entrypoint-entrada-de-ofertas/](http://www.b3.com.br/pt_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-desenvolvedores-e-vendors/entrypoint-entrada-de-ofertas/)

### A1. Logon

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A1.1	Cliente: Enviar Logon com informação de senha incorreta (tag 96)	Recebe a mensagem de Logout com rejeição de Logon	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.2	Cliente: Enviar Logon	Recebe a mensagem de Logon	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.3	Trading Certification: Alterar o sequencial da sessão para um valor acima do enviado pela sessão do cliente	Recebe a mensagem de Logout com rejeição de Logon, informando que o sequencial enviado foi muito baixo e que era esperado receber o valor informado por Trading Certification	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

### A2. Heartbeat

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A2.1	Cliente: Envia o Heartbeat	Recebe Heartbeat	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

### A3. Logout

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A3.1	Cliente: Envia o Logout	Recebe a confirmação do Logout	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

#### A4. Resend Request

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A4.1	<p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=1 e 16=0)</p>	<p>Cliente: Recebe a retransmissão</p> <p>Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.2	<p>Cliente desconecta da Bolsa</p> <p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=101 e 16=0)</p>	<p>Recebe a retransmissão</p> <p>Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E



B. Mensagem de mercado					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B.1	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.2	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra para ser rejeitada	Cliente: Recebe rejeição da oferta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.3	TRADING CERTIFICATION: Enviar alteração de ordem de compra	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.4	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.5	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda para ser rejeitada	Cliente: Recebe rejeição da oferta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.6	TRADING CERTIFICATION: Enviar alteração de ordem de venda	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.7	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento das ordens	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.8	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra e venda para fechar negócio (parcial e total)	Cliente: Recebe os Execution Reports de compra e venda e o de negócio	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B.9	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento do negócio gerado no passo anterior	Cliente: Recebe o Execution Report do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

### C. H.A. – Falha na instância principal da aplicação

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
D.1	Cliente: Enviar 10 Ofertas de compra limitada, DIA • 10000@12%	Recebe 10 Execution Report's	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Trading Certification: Executa o processo que irá simular falha na instância principal para que o DropCopy suba na instância de H.A. Obs: O tempo configurado para que a instância de H.A. suba no ambiente de certificação é de 30 segundos (esse valor pode ser diferente do ambiente de produção).					
D.2	Cliente: Reconectar a sessão de Drop Copy antes da virada estar concluída (tempo menor que 30 segundos)	Cliente: Não consegue reconectar	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D.3	Cliente: Reconectar a sessão de Drop Copy	Cliente: Reconecta e o SequenceNumber é incrementado corretamente	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D.4	Cliente: Enviar 10 Ofertas de compra limitada, DIA 10000@12%	Cliente: Recebe 10 Execution Report's	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D.5	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D.6	Trading Certification: Enviar cancelamento das 10 ofertas de compra limitada, DIA	Cancelamento das ofertas pendentes	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D.7	Cliente: Envia o Resend Request de todas as mensagens	Cliente: Recebe a retransmissão Cliente: Confirma o SequenceNumber da primeira e da última mensagem	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

### D. Limitação da Mensagem de Retransmissão

Disponível em: PUMA Equities; PUMA Derivativos  
Modelos de acesso: Mesa e DMA

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
E.1	Cliente: Solicitar a retransmissão de uma quantidade de mensagens maior que o limite de certificação.	Recebimento mensagem de rejeição (35=3) informando que foi ultrapassado o limite máximo de mensagens	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E.2	Cliente: Solicitar a retransmissão simultânea.	Recebimento mensagem de rejeição (35=3) informando que apenas uma retransmissão pode ser solicitada por vez.	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E.3	Cliente: Solicitar a retransmissão simultânea.	Recebimento de mensagem de desconexão (35=5) informando que foi ultrapassado o limite de solicitações de retransmissão simultânea	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E