



BRASIL
BOLSA
BALCÃO

UMDF PUMA Conflated

Roteiro de Certificação

Version: 1.3
Last modified:
29/08/2019

Contato

Trading Certification

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

Conteúdo

1. Prefácio	5
2. Pré requisitos	6
3. Glossário.....	7
A. Mensagens de Sessão.....	8
B1. Lista de Instrumentos	8
B2. Dados de Mercado.....	9
C1. Pré-Abertura	10
C2. Mercado Aberto.....	10
C3. Leilão Especial.....	12
C4. Mercado em Pausa	13
C5. Final Closing Call	14
C6. After Market	15
C7. Índices e ETFs.....	16
D. Notícias	16
E. Snapshot.....	17
F. Derivativos.....	17
G. Estratégia Definida pelo Usuário (UDS).....	18
H. Totalizadores	19

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Autor
22 de Abril de 2014	1.0	- Criação do documento	AMS
02 de Julho de 2014	1.1	- Adaptação para Certificação automatizada no MyCTC	AMS
02 de Setembro de 2014	1.2	- Revisão de cenários requeridos	MAB
29 de Agosto de 2019	1.3	- Remoção dos cenários "Unified News Channel", "Empréstimo de Títulos – BTC", Histórico de Negócios	Trading Certification

1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualificam *vendors* a conectar-se à B3 com o propósito de solicitar e receber dados de mercado (*market data*) nos segmentos de Ações e Derivativos via protocolo FIX 4.4

O protocolo FIX é uma especificação técnica para a comunicação eletrônica de mensagens de negócio. É um protocolo padronizado e aberto, mantido por membros da FIX Protocol Ltd. (www.fixprotocol.org)

Este documento especifica o processo de certificação para o recebimento da difusão do sinal de dados de mercado da B3 no formato UMDf PUMA Conflated, oferecido aos participantes que necessitem de conexão 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 o padrão especificado no documento “UMDF PUMA Conflated FIX Market Data Messaging Specification, disponível para download no site da B3: http://www.b3.com.br/pt_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-desenvolvedores-e-vendors/umdf-puma-conflated/

3. Glossário

MBO	Mercado Por Oferta
MBP	Mercado Por Preço
TOB	Topo do Book
TOP	Preço Teórico de Abertura
UDS	Estratégia Definida pelo Usuário
MOA	Market On Auction
MOC	Market On Close
ETF	Exchange Traded Funds (Fundos de Índices)

A. Mensagens de Sessão

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
A1.1	Enviar Logon	Receber confirmação de Logon	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
A1.2	Aguardar intervalo de Heartbeat.	Receber Heartbeat	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
A1.3	Enviar Logout.	Receber confirmação de Logout.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B1. Lista de Instrumentos

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B1.1	Assinar todos os instrumentos 263=1	Receber Security List 560=0	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.2	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.3	Assinar instrumentos por tipo 263=1 tag 167	Receber Security List 560=0	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.4	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.5	Assinar instrumentos por tipo inválido 263=1 tag 167	Receber mensagem de rejeição.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.6	Assinar instrumentos por produto 263=1 tag 460	Receber Security List 560=0	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.7	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.8	Assinar instrumentos por produto inválido 263=1 tag 460	Receber mensagem de rejeição.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.9	Assinar instrumentos por CFICode 263=1 tag 461	Receber SecurityList 560=0	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.10	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B1.11	Assinar instrumentos por CFICode inválido 263=1 tag 461	Receber mensagem de rejeição.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
-------	---	-------------------------------	---	---------------------------------	------------------------------

B2. Dados de Mercado

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B2.1	Assinar todos os instrumentos 263=1	Snapshot Full Refresh de todos os instrumentos disponíveis para mercado.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.2	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.3	Assinar apenas um instrumento	Snapshot Full Refresh do instrument recebido.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.4	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.5	Assinar instrumentos por grupo.	Snapshot Full Refresh de instrumentos do grupo assinado	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.6	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.7	Assinar instrumento por tipo	Snapshot Full Refresh de instrumentos do tipo assinado	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.8	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.9	Assinar instrumento por produto	Snapshot Full Refresh de instrumentos do produto assinado.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.10	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.11	Assinar instrumentos por CFICode	Snapshot Full Refresh de instrumentos com CFI Code assinado.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.12	Cancelar assinatura 263=2	Receber confirmação de cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C1. Pré-Abertura

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar Fase de Pré-Abertura

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C1.1	Assinar instrumento escolhido	MBO: Snapshot Full Refresh com tag 625=21	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Snapshot Full Refresh com tag 625=21		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento.	MBO: Nova ordem de compra no 6º nível	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Atualização do 3º nível na Compra		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.3	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	MBO: Novo topo do book de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo topo do book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.4	TRADING CERTIFICATION envia MOA de Compra e ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	MBO: Novo topo do book de Compra e 2º nível de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo topo do book de compra e aumento de quantidade no topo do book de venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.5	TRADING CERTIFICATION cancela ordens de Compra e Venda ao Preço de Fechamento	MBO: Deleção do 7º nível de Compra e 2º nível de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Diminuição de quantidade do 4º nível de Compra e do Topo do Book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.6	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para ABERTO	MBO: Atualização de todos os níveis e negócio realizado ao Preço de Fechamento	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Atualização de todos os níveis e negócio realizado ao Preço de Fechamento		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C1.7	Cancelar assinatura do instrumento escolhido		S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C2. Mercado Aberto

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C2.1	Assinar instrumento escolhido	MBO: Snapshot Full Refresh com tag 625=17	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Snapshot Full Refresh com tag 625=17		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C2.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento	MBO: Novo 6º nível de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Atualização do 3º nível de Compra		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.3	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Melhor Preço.	MBO: Novo 3º nível na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Aumento de quantidade no topo do book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.4	TRADING CERTIFICATION altera estado do instrumento para PAUSED	MBO: Recebe Security Status (35=f) com 326=02 e 1174=101	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Recebe Security Status (35=f) com 326=02 e 1174=101		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.5	TRADING CERTIFICATION cancela melhor ordem de venda	MBO: Novo topo do book na Venda.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Diminuição de quantidade no Topo do Book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.6	TRADING CERTIFICATION altera Estado do Instrumento para Reservado.	MBO: Recebe Security Status (35=f) com 326=21 e 1174=101	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Recebe Security Status (35=f) com 326=21 e 1174=101		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.7	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento.	MBO: Novo Topo do Book na Venda.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book na Venda.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.8	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para Aberto.	MBO: Incremental Refresh com novo Topo do Book na venda, negócios gerados e Delete From BID (279=4); Security Status muda para 326=17 com 1174=102	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Incremental Refresh com novo Topo do Book na venda, negócios gerados e Delete From BID (279=4); Security Status muda para 326=17 com 1174=102		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C2.9	TRADING CERTIFICATION envia 2 ordens de compra com preço de fechamento + 1 tick.	MBO: Novo Topo do Book e 2º nível na Compra.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book de Compra.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.10	TRADING CERTIFICATION envia negócio on behalf.	MBO: Novo Negócio com tag 277=2	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Negócio com tag 277=2		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.11	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para Fechado.	MBO: Incremental Refresh com Delete From (279=4); Security Status muda para 326=04	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Incremental Refresh com Delete From (279=4); Security Status muda para 326=04		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.12	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para Aberto.	MBO: Security Status muda para 326=17 com 1174=102	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Security Status muda para 326=17 com 1174=102		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C2.13	Cancelar assinatura do instrumento escolhido		S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C3. Leilão Especial

Disponível: Equities

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar Leilão Especial

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C3.1	TRADING CERTIFICATION configura o instrumento para Leilão Especial	MBO: Receber Security List com 37015=8	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Security List com 37015=8		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C3.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento	MBO: Novo Topo do Book de Compra	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book de Compra		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C3.3	TRADING CERTIFICATION envia nova Venda 100@Preço de Fechamento acrescido de um tick.	MBO: Novo Topo do Book de Venda	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C3.4	TRADING CERTIFICATION envia MOA na Compra	MBO: Novo Topo do Book de Compra sem preço	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book de Compra sem preço		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C3.5	TRADING CERTIFICATION modifica preço de Venda	MBO: Novo Topo do Book de Venda	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C3.6	TRADING CERTIFICATION altera Estado do Instrumento para Aberto.	MBO: Novos negócios e Security Status muda para 326=17.	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novos negócios e Security Status muda para 326=17.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C3.7	TRADING CERTIFICATION envia ordens de Compra e Venda	MBO: Novo Topo do Book em ambos os lados	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book em ambos os lados		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C3.8	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para Pause.	MBO: Security Status muda para 625=02	C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Security Status muda para 625=02		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C3.9	Cancelar assinatura do instrumento escolhido		C	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C4. Mercado em Pausa

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C4.1	Assinar instrumento escolhido.	MBO: Snapshot Full Refresh com 625=02	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Snapshot Full Refresh com 625=02		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C4.2	TRADING CERTIFICATION cancela ordem de Compra	MBO: Receber Incremental Refresh com deleção de Compra (269=0 e 279=2)	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Incremental Refresh com deleção de Compra (269=0 e 279=2)		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C4.3	TRADING CERTIFICATION cancela ordem de Venda	MBO: Receber Incremental Refresh com deleção de (269=1 e 279=2)	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Incremental Refresh com deleção de (269=1 e 279=2)		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C4.4	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para PRE-CLOSE	MBO: Receber Security Status com 625=18	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Security Status com 625=18		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C4.5	Cancelar assinatura do instrumento escolhido		S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C5. Final Closing Call

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar o FCC

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C5.1	Assinar instrumento escolhido.	MBO: Snapshot Full Refresh com tag 625=101 e 326=101 e ordem MOC na compra.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Snapshot Full Refresh com tag 625=101 e 326=101 e ordem MOC na compra.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C5.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	MBO: Novo Topo do Book de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C5.3	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento + 1 tick.	MBO: Novo 2º nível de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo 2º nível de Compra		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C5.4	TRADING CERTIFICATION altera quantidade em ordem de Venda	MBO: Aumento de quantidade na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Aumento de quantidade na Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C5.5	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	MBO: Novo 2º nível de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Aumento de quantidade na Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C5.6	Encerramento do Final Closing Call	MBO: Novos negócios.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novos negócios		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C5.7	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para PRÉ-FECHAMENTO.	MBO: Security Status com tag 625=18	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Security Status com tag 625=18		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C5.8	Cancelar assinatura do instrumento escolhido	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
------	--	---	---------------------------------	------------------------------

C6. After Market

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar After Market e popular o book.

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C6.1	Assinar instrumento escolhido.	MBO: Snapshot Full Refresh com 625=17 e 336=6	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Snapshot Full Refresh com 625=17 e 336=6		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C6.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento.	MBO: Nova ordem de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Nova ordem de Compra		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C6.3	TRADING CERTIFICATION envia nova ordem de Venda 100@Melhor preço.	MBO: Novo 3º nível na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Aumento de quantidade no Topo do Book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C6.4	TRADING CERTIFICATION deleta Topo de Book da Venda	MBO: Novo Topo de Book na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Redução de quantidade no Topo do Book de Venda		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C6.5	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	MBO: Novo Topo do Book de Venda, Delete From na Compra e novos negócios (1174=102)	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book de Venda, Delete From na Compra e novos negócios (1174=102)		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C6.6	TRADING CERTIFICATION envia duas ofertas – Ordem de compra 100@Preço de fechamento e Ordem de compra 100@Preço de Fechamento + 1 tick.	MBO: Novo Topo do Book e 2º nível de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Novo Topo do Book		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C6.7	TRADING CERTIFICATION altera Estado do Instrumento para FECHADO	MBO: Incremental Refresh com Delete From (279=4); Security Status muda para 326=04	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Incremental Refresh com Delete From (279=4); Security Status muda para 326=04		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C6.8	Cancelar assinatura do instrumento escolhido	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
------	--	---	---------------------------------	------------------------------

C7. Índices e ETFs

Disponível: Equities

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
C7.1	Assinar Índice	MBO: Snapshot Full Refresh com tag 1500=N	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C7.2	TRADING CERTIFICATION gera negócios para instrumentos que fazem parte da composição do Índice utilizado.	MBO: Incremental Refresh com atualização no Valor do Índice.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C7.3	Aguardar por 30 segundos para nova publicação do Índice.	MBO: Incremental Refresh com atualização no Valor do Índice.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
C7.4	Cancelar assinatura do instrumento escolhido		N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

D. Notícias

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
D1.1	Assinar instrumento (35=V)	Receber Snapshot Full Refresh (35=W)	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D1.2	TRADING CERTIFICATION envia Notícia para instrumento assinado.	Receber Notícia (35=B)	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D1.3	Cancelar assinatura do instrumento escolhido		N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

E. Snapshot

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
E1.1	Cliente assina o instrumento utilizado com book vazio.	MBO: Receber Snapshot Full Refresh com book vazio.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Snapshot Full Refresh com book vazio.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
E1.2	Cliente cancela a assinatura do instrumento, TRADING CERTIFICATION envia ordens de Compra. Cliente assina o instrumento.	MBO: Receber Snapshot Full Refresh com ordens de compra no book.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Snapshot Full Refresh com ordens de compra no book.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
E1.3	Cliente cancela a assinatura do instrumento, TRADING CERTIFICATION envia ordens de Venda. Cliente assina o instrumento.	MBO: Receber Snapshot Full Refresh com ordens de venda no book.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Snapshot Full Refresh com ordens de venda no book.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
E1.4	TRADING CERTIFICATION envia ordens que gerem negócios.	MBO: Receber Incremental Refresh com novos negócios.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Incremental Refresh com novos negócios.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

F. Derivativos

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
F1.1	Assinar instrumento de contrato Futuro (167=FUT)	Receber Snapshot Full Refresh com Open Interest, Preço de Referência e Preço de Ajuste	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
F1.2	TRADING CERTIFICATION gera ordens em aberto.	Incremental Refresh com Open Interest (269=C)	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

G. Estratégia Definida pelo Usuário (UDS)

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
G1.1	TRADING CERTIFICATION cria nova UDS com duas patas	MBO: Receber Security List (35=y) no canal de Opções referente à primeira pata. Verificar tag 555.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Security List (35=y) no canal de Opções referente à primeira pata. Verificar tag 555.		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
G1.2	Assinar UDS criada	MBO: Receber Snapshot Full Refresh	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Snapshot Full Refresh		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
G1.3	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para RESERVADO	MBO: Receber Security Status (35=f) com tag 326=21	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Security Status (35=f) com tag 326=21		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
G1.4	TRADING CERTIFICATION envia ordem de compra para a UDS	MBO: Nova compra no Top do Book	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Nova compra no Top do Book		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
G1.5	TRADING CERTIFICATION altera o estado para Aberto.	MBO: Receber Security Status (35=f) com tag 326=17	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Receber Security Status (35=f) com tag 326=17		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
G1.6	TRADING CERTIFICATION envia ordem de venda para a UDS.	MBO: Negócio fechado na UDS e patas	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
		MBP: Negócio fechado na UDS e patas		<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
G1.7	Cancelar assinatura do instrumento escolhido		N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

H. Totalizadores

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
H1.1	Assinar Totalizadores (35=UTOTQ, 263=1)	Receber confirmação de assinatura (35=UTOTP) Receber Totalizadores (35=UTOTC)	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
H1.2	Aguardar 30 segundos.	Receber atualização de totalizador (35=UTOT)	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
H1.3	Assinar Totalizadores com MDReqID repetido (35=UTOTQ, 263=1)	Receber rejeição de assinatura (35=UTOTP, 281=1)	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
H1.4	Cancelar assinatura de Totalizadores (35=UTOTQ, 263=2)	Assinatura cancelada	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
H1.5	Cancelar novamente a mesma assinatura de Totalizadores (35=UTOTQ, 263=2)	Receber rejeição de assinatura (35=UTOTP, 281=Y)	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E