

**BM&FBOVESPA**

*A Nova Bolsa*



# EntryPoint Drop Copy

## Roteiro de Certificação

Versão: 1.3

Última modificação: 20/01/2014



## Contato

Centro de testes e Certificação - CTC

- [ctc@bvmf.com.br](mailto:ctc@bvmf.com.br)
- +55 11 2565-5500

---

## Índice

<b>1. PREFÁCIO</b> .....	<b>5</b>
<b>2. INTRODUÇÃO</b> .....	<b>6</b>
PRÉ-REQUISITOS.....	6
<b>A1. LOGON</b> .....	<b>7</b>
<b>A2. HEARTBEAT</b> .....	<b>7</b>
<b>A3. LOGOUT</b> .....	<b>7</b>
<b>A4. RESEND REQUEST</b> .....	<b>8</b>
<b>B1. ORDEM DE COMPRA</b> .....	<b>9</b>
<b>B2. ORDEM DE VENDA</b> .....	<b>9</b>
<b>C1. EXECUÇÃO PARCIAL E TOTAL</b> .....	<b>11</b>
<b>C2. CANCELAMENTO EM DESCONEXÃO</b> .....	<b>11</b>
<b>C3. EXECUÇÃO TOTAL ON BEHALF</b> .....	<b>11</b>
<b>D. NEGOCIAÇÃO DE ESTRATÉGIAS</b> .....	<b>11</b>

## Histórico de Versões

Data	Versão	Descrição	Autor
7 de agosto de 2013	1.0	- Criação do roteiro.	DC
23 de agosto de 2013	1.1	- Atualização de nomenclatura dos cenários e automação do roteiro.	AMS
6 de setembro de 2013	1.2	- Alteração do cenário de Logon Reject - Alteração nos cenários de Resend Request - Remoção dos cenários de Test Request - Remoção dos cenários de Exercício e Bloqueio	AMS
20 de janeiro de 2014	1.3	- Atualização do cenário "A4. Resend Request" - Cenário "B4. Alteração da Ordem de Compra" incorporado ao cenário "B1. Ordem de Compra" - Cenário "B5. Alteração da Ordem de Venda" incorporado ao cenário "B2. Ordem de Venda" - Atualização do cenário "C1. Execução Parcial e Total" - Atualização do cenário "D. Negociação de Estratégias"	AMS

---

## 1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualifica uma instituição de terceiros conectar na BM&FBOVESPA com o propósito de validar o funcionamento de Drop Copy nos segmentos 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 BM&FBOVESPA e é fornecido para terceiros que precisam de conectividade para negociação com a BM&FBOVESPA.

Para requisitar cópias desse documento, favor contatar: [ctc@bvmf.com.br](mailto:ctc@bvmf.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 BM&FBOVESPA em <http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/servicos/solucoes-para-negociacao/plataformas-de-negociacao/puma-trading-system/puma-trading-system.asp?Idioma=pt-br>

A1. Logon					
Obs: Não deverá ocorrer o envio das mensagens com Tag 141=Y na sessões de negociação ou Drop copy					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A1.1	CTC desabilita sessão FIX Cliente envia Logon	Recebe a rejeição do 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

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					
Disponível em: Equities e Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A4.1	CTC: Gera massa de 10 mensagens Cliente: Envia o Resend Request das 10 primeiras mensagens (tags 7=1 e 16=0)	Cliente: Recebe a retransmissão Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.2	Cliente desconecta da Bolsa CTC: Gera massa de 10 mensagens Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=11 e 16=0)	Recebe a retransmissão Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.3	Cliente desconecta da Bolsa CTC: Gera massa de 10 mensagens Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=21 e 16=0)	Recebe a retransmissão Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.4	Cliente desconecta da Bolsa CTC: Gera massa de 10 mensagens Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=31 e 16=0)	Recebe a retransmissão Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.5	Cliente desconecta da Bolsa CTC: Gera massa de 20 mensagens por 2 sessões de Order Entry distintas (10 em cada sessão) Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=41 e 16=0)	Recebe a retransmissão Cliente: Confirma quantas mensagens referentes a cada sessão Order Entry foram recebidas	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.6	CTC: Gera massa de 10 mensagens Cliente: Recebe mensagens Cliente: desconecta a sessão CTC: Gera nova massa de 10 mensagens Cliente: Reconecta a sessão Cliente: Envia Resend Request apenas das mensagens faltantes (tags 7=71 e 16=0)	Recebe as mensagens  Recebe apenas as mensagens faltantes (tag 34 da última mensagem recebida deve ser igual a tag 34 da última mensagem da massa gerada)	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

<b>B1. Ordem de Compra</b> Disponível em: Equities e Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B1.1	CTC: Enviar ordem de compra	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.2	CTC: Enviar alteração de ordem de compra	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.3	CTC: Enviar cancelamento da oferta	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.4	CTC: Enviar ordem On Behalf	Recebe o Execution Report do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.5	CTC: Enviar alteração de ordem de compra (On Behalf)	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.6	CTC: Enviar cancelamento de ordem de compra (On Behalf)	Recebe o Execution Report do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.7	CTC: Enviar ordem de compra fora do preço	Cliente: Recebe rejeição da oferta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.8	CTC: Enviar alteração de ordem de compra	Recebe o Execution Report de rejeição	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.9	CTC: Enviar cancelamento da oferta	Cliente: Recebe rejeição do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.10	CTC: Enviar alteração de ordem de compra (On Behalf)	Recebe o Execution Report de rejeição	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.11	CTC: Enviar ordens através de 2 sessões order Entry distintas	Cliente: Recebe o Execution Report e identifica por qual sessão Order Entry a ordem foi enviada	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

<b>B2. Ordem de Venda</b> Disponível em: Equities e Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B2.1	CTC: Enviar ordem de venda	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.2	CTC: Enviar alteração de ordem de venda	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.3	CTC: Enviar cancelamento da oferta	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.4	CTC: Enviar ordem On Behalf	Recebe o Execution Report do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

B2.5	CTC: Enviar alteração de ordem de venda (On Behalf)	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.6	CTC: Enviar cancelamento de ordem de venda (On Behalf)	Recebe o Execution Report do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.7	CTC: Enviar ordem de venda fora do preço	Cliente: Recebe rejeição da oferta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.8	CTC: Enviar alteração de ordem de venda	Recebe o Execution Report de rejeição	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.9	CTC: Enviar cancelamento da oferta	Cliente: Recebe rejeição do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.10	CTC: Enviar alteração de ordem de venda (On Behalf)	Recebe o Execution Report de rejeição	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.11	CTC: Enviar ordens através de 2 sessões order Entry distintas	Cliente: Recebe o Execution Report e identifica por qual sessão Order Entry a ordem foi enviada	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

<b>B3. Direto</b> Disponível em: Equities e Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B3.1	CTC: Enviar um Direto	Recebe o Execution Report de aceite e negócio.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B3.2	CTC: Enviar um Direto	Recebe o Execution Report de rejeição	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

<b>C1. Execução Parcial e Total</b> Disponível em: Equities e Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C1.1	CTC: Enviar ordem de compra LIMITADA DIA de 300 Envia ordem LIMITADA DIA de venda de 100	Recebe execução parcial da ordem de compra Execução total da venda	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.2	CTC: Modificar quantidade restante da ordem de compra para 100	Recebe Execution Report de modificação da ordem de compra	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.3	CTC: Envia ordem LIMITADA DIA de venda de 100	Execução total	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

<b>C2. Cancelamento em Desconexão</b> Disponível em: Equities Modelo de acesso: DMA					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C2.1	CTC: LOGON CoD TIPO 3 na Sessão Order Entry CTC: Envia 1 ordem DIA e 1 ordem GTC na Sessão Order Entry CTC: Força a desconexão da Sessão Order Entry	Cliente: Recebe Execution Report de entrada das ordens  Recebe o cancelamento da ordem DIA ativado pelo CoD	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

<b>C3. Execução Total On Behalf</b> Disponível em: Equities e Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C3.1	CTC: Insere um negócio	Cliente: Recebe execução do negócio.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

<b>D. Negociação de Estratégias</b> Disponível em: Equities Modelos de acesso: Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
D.1	CTC: Envia ordem de compra para UDS	CLIENTE recebe 1 Execution Report para UDS	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D.2	CTC: Negocia UDS	CLIENTE recebe 1 Execution Report para UDS e 1 por pata	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E