



14 de maio de 2024
028/2024-VNC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Market Data B3 – Atualização de especificação técnica do Market Data Binário e arquivo de templates**

Informamos que estão disponíveis novas versões de especificações técnicas do protocolo UMDF Binário e arquivo de templates. Essa ação faz parte do processo de aprimoramento contínuo de seus sistemas de negociação e visa a antecipar o planejamento dos participantes de mercado para o lançamento de produtos e funcionalidades.

As atualizações são as descritas a seguir.

- 1. Adição da mensagem *settlement price*** (ou preço de ajuste) – termo utilizado nos mercados financeiros de futuros que se refere ao preço oficial pelo qual um contrato de derivativos é liquidado no fim de cada dia de negociação. Esse campo, presente atualmente apenas no UMDF FIX/FAST, com essa atualização, passará a estar presente também no UMDF Binário, e o Market Data Binário estará apto a publicar o *settlement price* para esses contratos.
- 2. Adição da mensagem *open interest*** (ou contratos em aberto) – conceito utilizado nos mercados de derivativos, como futuros, para indicar o número total de contratos financeiros abertos. Esse campo, presente atualmente apenas no UMDF FIX/FAST, com essa atualização, passará a estar presente

também no UMDF Binário, e o Market Data Binário estará apto a publicar o *open interest* para esses contratos.

- 3. Adição do valor "SWEEP_TRADE" no campo trdSubType (tag 829)*** – a funcionalidade *sweep and cross* refere-se a uma estratégia de execução de ordens no mercado financeiro que envolve duas etapas principais: (i) a etapa "sweep", que consiste em executar ordens contra todas as ofertas disponíveis no livro de ordens central até um determinado preço, buscando a melhor execução possível; e (ii) após essa varredura, a etapa "cross", realizada onde uma ordem direta é registrada. Essa ordem direta permite que as operações sejam automatizadas para os clientes, de modo que uma das partes da transação é executada contra as ofertas existentes no livro de ordens, antes de finalizar a operação com a outra parte diretamente. Com essa nova versão, os negócios oriundos dessa funcionalidade executados contra o livro central poderão ser identificados no Market Data Binário.

(*)Essa funcionalidade está sujeita à aprovação do regulador. A data efetiva de lançamento será informada oportunamente.

- 4. Arquivo de templates** – as atualizações dos documentos Binary UMDF – Message Reference v1.8.0, Binary UMDF – Messaging Specification Guidelines v1.8.0 e b3-market-data-messages v1.8.0 estão disponíveis para consulta em <https://www.b3.com.br>, Soluções, Plataformas, Puma Trading System, Desenvolvedores e Vendors, Market Data Binário, UMDF Binário. A atualização para a nova versão do arquivo de templates **não será obrigatória**, pois é retrocompatível com a versão anterior. A versão 1.8.0 do arquivo de templates estará atualizada em ambiente de certificação a partir do dia **15/05/2024**.

Em ambiente de produção, as publicações do Market Data Binário serão feitas com base no "Schema version" 9. As datas estão detalhadas em <https://clientes.b3.com.br>, Conteúdo, Notícias, Notícias em destaque, Próximas entregas para o mercado | Negociação, na linha "UMDF Binário – Atualização do Arquivo de Templates".

Por ora, trata-se apenas da pavimentação prévia do arquivo de templates para suportar a publicação dessas novas mensagens, que, de fato, serão publicadas em data futura.

5. Publicação das mensagens – a publicação das novas mensagens de *settlement price* e *open interest* estará disponível para validação em ambiente de certificação a partir do dia **19/08/2024**. Quanto à publicação da mensagem **SWEEP_TRADE**, a data será informada oportunamente.

Em produção, as ondas de atualização sobre as mensagens de *settlement price* e *open interest* estão detalhadas em <https://clientes.b3.com.br>, Conteúdo, Notícias, Notícias em destaque, Próximas entregas para o mercado | Negociação, "UMDF Binário – Publicação das Mensagens Settlement Price e Open Interest".

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com o Atendimento B3 – Suporte à Negociação pelo telefone (11) 2565-5021 ou e-mail suporteanegociacao@b3.com.br.

Mario Palhares
Vice-Presidente de Operações – Negociação Eletrônica e CCP