



BRASIL
BOLSA
BALCÃO

Trademate

Order Entry – Títulos Privados

Roteiro de Certificação

Versão: 1.0

Última modificação: 03/05/2024

Contato

Trading Certification

- tradingcertification@b3.com.br
- +55 11 2565-5023

Índice

Histórico de Versões	4
Criação do arquivo	4
Atualização do arquivo	Erro! Indicador não definido.
1. Prefácio	5
2. Introdução.....	5
A. Ordens Papéis CFF	7
A2. Ordens Papéis CRI, CRA e Debêntures.....	8
B. Ordens com Quantidade Aparente.....	9
C. Ordens com Instrumento em Leilão	10
E. Ordens Papéis Secos (Liquidity Seeking).....	11

Histórico de Versões

Data	Versão	Descrição	Autor
02 de maio de 2024	1.0	Criação do arquivo	Trading Certification

1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualifica uma instituição conectar na B3 com o propósito de enviar ofertas CLOB no segmento de renda fixa via Trademate.

Para requisitar cópias desse documento, favor contatar: 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

https://clientes.b3.com.br/c/document_library/get_file?groupId=20119&uuid=7b7409cc-4639-289e-d62d-1062d48339cb&groupId=20119

https://clientes.b3.com.br/c/document_library/get_file?groupId=20119&uuid=5084ec4b-d8e0-8cf2-173a-7cc69b405dae&groupId=20119

A. Cotas de Fundo Fechado (CFF)

Tags: 35=D; 40=2; 59=0

i.e. taxa = 10%; taxa-0,01 = 9,99%

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 1@PU TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 1@PU	Execução total das ordens - Negócio gerado	S	Pass	N/E
A.2	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 2@PU TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 1@PU	Execução parcial das ordens - Negócio gerado Ordens no book: • Compra 1@PU	S	Pass	N/E
A.3	Cliente: Modificar ordem de compra pendente • De: 1@PU • Alterar para: 2@PU	Modificação da ordem pendente no book Ordens no book: • Compra 2@PU	S	Pass	N/E
A.4	TRADING CERTIFICATION: configura o book sem ordens Cliente: Enviar ordem de compra a mercado	Rejeição da ordem a mercado	S	Pass	N/E
A.5	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra limitada Cliente: Enviar ordem de venda a mercado	Execução total das ordens - Negócio gerado	S	Pass	N/E
A.6	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 1@PU	Execução parcial da ordem modificada - Negócio gerado Ordens no book: • Compra 1@PU	S	Pass	N/E
A.7	Cliente: Enviar cancelamento da ordem disponível • Quantidade book: 1@PU	Cancelamento da ordem disponível	S	Pass	N/E
A.8	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 1@PU Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 1@PU+0,01	Ordens no book: • Compra 1@PU • Venda 1@PU+0,01	S	Pass	N/E

A.9	<p>Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> De: Venda 1@PU+0,01 Alterar para: 2@PU 	<p>Execução parcial da ordem modificada - Negócio gerado</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Venda 1@PU 	S	Pass	N/E
A.10	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados (em desenvolvimento)	S	Pass	N/E

A2. CRI, CRA e Debênture

Tags: 35=D; 40=2; 59=0

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A2.1	<p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU 	Execução total das ordens	S	Pass	N/E
A2.2	<p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 2@PU <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU 	<p>Execução parcial das ordens</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 1@PU 	S	Pass	N/E
A2.3	<p>Cliente: Modificar ordem de compra</p> <ul style="list-style-type: none"> De: 1@PU Alterar para: 2@PU 	<p>Modificação da ordem no book</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 2@PU 	S	Pass	N/E
A.2.4	<p>TRADING CERTIFICATION: configura o book sem ordens</p> <p>Cliente: Enviar ordem de compra a mercado</p>	Rejeição da ordem a mercado	S	Pass	N/E
A.2.5	<p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra limitada</p> <p>Cliente: Enviar ordem de venda a mercado</p>	Execução total das ordens - Negócio gerado	S	Pass	N/E
A2.6	<p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU 	<p>Execução parcial da ordem modificada - Negócio gerado</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 1@PU 	S	Pass	N/E

A2.7	<p>Cliente: Enviar cancelamento da ordem</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade book: 10000@10bps 	Cancelamento da ordem.	S	Pass	N/E
A2.8	<p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU <p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU 	<p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 1@PU Venda 1@PU 	S	Pass	N/E
A2.9	<p>Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> De: 1@PU Alterar para: 2@PU 	<p>Execução parcial da ordem modificada</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Venda 1@PU 	S	Pass	N/E
A 3	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados (em desenvolvimento)	S	Pass	N/E

B. Ordens com Quantidade Aparente

Tag: 111

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status
B.1	<p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 2@PU Quantidade aparente: 1 <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU 	Execução parcial e total da ordem	N	Pass N/E
B.2	<p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 2@PU Quantidade aparente: 1 <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 1@PU 	Execução parcial e total da ordem	N	Pass N/E
B.3	<p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 3@PU Quantidade aparente: 1 	Execução parcial 1 e Execução parcial 2	N	Pass N/E

C. Ordens com Instrumento em Leilão					
Tags: 35=D; 40=2; 59=0					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
TRADING CERTIFICATION: Verifica taxa/preço âncora do ativo. CLIENTE e TRADING CERTIFICATION: Inserir taxa/preço que seja que esteja dentro do intervalo de rejeição, mas fora do túnel de leilão (disparar leilão) = precotriggerleilao					
D.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 2@precotriggerleilao TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 2@precotriggerleilao	Registro das ordens e disparo do leilao Ordens no book: • Compra 2@ precotriggerleilao • Venda 2@precotriggerleilao	S	Pass	N/E
D.2	Cliente: Reduzir quantidade da ordem • 1@ precotriggerleilao	Rejeição de modificação Ordens no book: • Compra 2@precotriggerleilao • Venda 2@precotriggerleilao	S	Pass	N/E
D.3	Cliente: Cancelar a ordem de compra	Rejeição de cancelamento Ordens no book: • Compra 2@precotriggerleilao • Venda 2@precotriggerleilao	S	Pass	N/E
D.4	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA , durante o leilão • 2@precotriggerleilao	Registro da ordem Ordens no book: • Compra 2@precotriggerleilao • Compra 2@precotriggerleilao-0,1 • Venda 2@taxatriggerleilao	S	Pass	N/E
D.5	Cliente: Piorar preço da ordem (Compra: preçotriggerleilao+0,1%) • 2@precotriggerleilao-0,15	Rejeição de modificação	S	Pass	N/E
D.6	Cliente: Melhorar preço da ordem (Compra: 0,8%) • 2@precotriggerleilao+0,15	Registro de modificação da ordem Ordens no book: • Compra 2@preçotriggerleilao-0,15% • Compra 2preço@preçotriggerleilao • Venda 2@preçotriggerleilao	S	Pass	N/E

E. Ordens Papéis Secos (Liquidity Seeking)

Tags: 35=D; 40=2; 59 = LS

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
E.1	<p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, LS</p> <ul style="list-style-type: none"> • 1@PU <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, LS</p> <ul style="list-style-type: none"> • 1@PU • Quantidade book: 1@PU 	Execução total das ordens - Negócio gerado	S	Pass	N/E
E.2	<p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra limitada, LS</p> <ul style="list-style-type: none"> • 1@PU, Participante A, TOP BROKER 1 • 1@PU, Participante B, TOP BROKER 2 <p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA, com TOP BROKER 1 e TOP BROKER 2 habilitados</p> <ul style="list-style-type: none"> • 2@tPU 	<p>Execução parcial 1 e Execução parcial 2</p> <p>Execução total das ordens</p>	S	Pass	N/E
E.3	<p>Cliente: Enviar ordem e modificação da ordem de venda pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> • De: 1@PU+0,01 • Alterar para: 2@taxa ou PU <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da oferta</p>	Sem ordens no book	S	Pass	N/E
E.4	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	S	Pass	N/E