



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

## Índice

Histórico de Versões .....	4
Criação do arquivo .....	4
Atualização do arquivo .....	<b>Erro! Indicador não definido.</b>
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](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**

[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=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](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"> <li>De: Venda 1@PU+0,01</li> <li>Alterar para: 2@PU</li> </ul>	<p>Execução parcial da ordem modificada - Negócio gerado</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Venda 1@PU</li> </ul>	S	Pass	N/E
A.10	<p>TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)</p>	<p>Cancelamento dos negócios gerados (em desenvolvimento)</p>	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"> <li>1@PU</li> </ul> <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1@PU</li> </ul>	<p>Execução total das ordens</p>	S	Pass	N/E
A2.2	<p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>2@PU</li> </ul> <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1@PU</li> </ul>	<p>Execução parcial das ordens</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Compra 1@PU</li> </ul>	S	Pass	N/E
A2.3	<p>Cliente: Modificar ordem de compra</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>De: 1@PU</li> <li>Alterar para: 2@PU</li> </ul>	<p>Modificação da ordem no book</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Compra 2@PU</li> </ul>	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>	<p>Rejeição da ordem a mercado</p>	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>	<p>Execução total das ordens - Negócio gerado</p>	S	Pass	N/E
A2.6	<p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1@PU</li> </ul>	<p>Execução parcial da ordem modificada - Negócio gerado</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Compra 1@PU</li> </ul>	S	Pass	N/E

A2.7	<p>Cliente: Enviar cancelamento da ordem</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Quantidade book: 10000@10bps</li> </ul>	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"> <li>1@PU</li> </ul> <p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1@PU</li> </ul>	<p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Compra 1@PU</li> <li>Venda 1@PU</li> </ul>	S	Pass	N/E
A2.9	<p>Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>De: 1@PU</li> <li>Alterar para: 2@PU</li> </ul>	<p>Execução parcial da ordem modificada</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Venda 1@PU</li> </ul>	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"> <li>2@PU</li> <li>Quantidade aparente: 1</li> </ul> <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1@PU</li> </ul>	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"> <li>2@PU</li> <li>Quantidade aparente: 1</li> </ul> <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1@PU</li> </ul>	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"> <li>3@PU</li> <li>Quantidade aparente: 1</li> </ul>	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"> <li>• 1@PU</li> </ul> <p>TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda limitada, LS</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 1@PU</li> <li>• Quantidade book: 1@PU</li> </ul>	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"> <li>• 1@PU, Participante A, TOP BROKER 1</li> <li>• 1@PU, Participante B, TOP BROKER 2</li> </ul> <p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA, com TOP BROKER 1 e TOP BROKER 2 habilitados</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 2@tPU</li> </ul>	<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"> <li>• De: 1@PU+0,01</li> <li>• Alterar para: 2@taxa ou PU</li> </ul> <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