

Market Data B3 – Atualização de especificação técnica e arquivo de templates

Destinado aos participantes do segmento: Listado.

Resumo: Estão disponíveis novas versões das especificações técnicas do Market Data B3: UMDF Binário, UMDF FIX/FAST e Conflated.

Como parte do processo de aprimoramento contínuo dos sistemas de negociação da B3, e visando auxiliar o planejamento dos participantes de mercado para o lançamento de produtos e funcionalidades, informamos que estão disponíveis novas versões das especificações técnicas do Market Data: UMDF Binário, UMDF FIX/FAST e Conflated.

Nesta atualização, será incluído um novo campo para informação da data de referência de um preço de ajuste. Adicionalmente, será realizada a pavimentação para suporte de opções com liquidação financeira e inclusão de melhorias pontuais.

Confira, a seguir, todas as atualizações nas especificações do UMDF Binário, UMDF FIX/FAST e Conflated.

1. Atualizações na especificação do UMDF Binário

As publicações do UMDF Binário passarão a ser feitas com base no novo “Schema version” 17, em ambiente de produção. A atualização para a nova versão do arquivo de templates não será obrigatória, pois é retrocompatível com a versão anterior, mas será necessária para uso das novas funcionalidades (Referência Binary UMDF – Messaging Specification Guidelines: 5.9 Schema Extension Mechanism).

Esta atualização tem como destaque:

- Campo opcional `settleDate` (tag 64) adicionado à mensagem `SettlementPrice`;
- O tamanho da mensagem `SettlementPrice` foi alterado de 36 para 40 bytes;
- Campo `openCloseSettleFlag` (tag 286) na mensagem `SettlementPrice` marcado como obsoleto (e opcional). Sua publicação será inicialmente mantida na atualização para o novo arquivo de templates, mas será desativada em um segundo momento, passando a ser necessária a utilização do novo campo `settleDate` para identificação da data de referência do preço de ajuste;
- No enum `OptPayoutType` a descrição do valor 2 foi alterada de "CAPPED" (sem uso) para "VANILLA_CASH_SETTLEMENT", para suportar opções com liquidação financeira;
- Adicionado o valor `TEST_INSTRUMENT` ao enum `InstrAttribType` para informar que o instrumento é negociável, mas não possui efeito sobre posições, no volume de negociações da bolsa etc. (para uso futuro na identificação dos instrumentos de teste);
- O nome 'Forbidden' foi substituído por 'Pre-Close', domínio 18 no enum `TradingSessionSubID`, para equalização da nomenclatura utilizada na especificação do Market Data;
- O nome 'Reserved' foi substituído por 'Pre-Open', domínio 21 no enum `TradingSessionSubID`, para equalização da nomenclatura utilizada na especificação do Market Data.

Os documentos de especificação técnica Binary UMDF – Message Reference v2.3.1, Binary UMDF – Messaging Specification Guidelines v2.3.1 e o novo arquivo de templates (b3-market-data-messages-2.3.1) poderão ser consultados no [site da B3](#) (Soluções > Plataformas > Puma Trading System > UMDF Binário).

2. Atualizações na especificação do UMDF FIX/FAST

As publicações do UMDF FIX/FAST passarão a ser feitas com base em um novo arquivo de templates (versão 5.1.19). A atualização para a nova versão do arquivo de templates **será obrigatória** e terá as seguintes alterações:

Atualizações no Market Data Incremental (35=X, novo templateID 158) e no Market Snapshot Full Refresh (35=W, novo templateID 159):

- Inclusão do campo opcional `settleDate` (tag 64) à mensagem `SettlementPrice` (269=6). Este campo representa a data de referência do preço de ajuste.
- A publicação do campo `openCloseSettleFlag` (tag 286) na mensagem `SettlementPrice` (269=6) será mantida inicialmente na atualização para o novo arquivo de templates, mas será desativada em um segundo momento, passando a ser necessária a utilização do novo campo `settleDate` para identificação da data de referência do preço de ajuste.

Atualizações adicionais na especificação:

- Inclusão de novo domínio na tag `1482-OptPayoutType` (2 - Vanilla - Cash Settlement), na mensagem de `SecurityList` (35=y);
- Inclusão na mensagem de `SecurityList` (35=y) de novo domínio na tag `871-InstrAttribType` (35 -TEST_INSTRUMENT) para informar que o instrumento é negociável, mas não possui efeito sobre posições, no volume de negociações da bolsa etc. (para uso futuro na identificação dos instrumentos de teste).

As especificações técnicas do UMDF FIX/FAST e novo arquivo de templates poderão ser consultados no [site da B3](#) (Soluções > Plataformas > Puma Trading System > UMDF).

3. Atualizações na especificação UMDF Conflated

As publicações do UMDF Conflated passarão a ser feitas com base em um novo dicionário FIX (versão 1.0.0.39). A atualização para a nova versão **será obrigatória** e terá as seguintes alterações:

- Inclusão do campo opcional `settleDate` (tag 64) à mensagem Incremental de `SettlementPrice` (35=X, 269=6) e de `Snapshot Full Refresh` (35=W, 269=6). Este campo representa a data de referência do preço de ajuste;

- A publicação do campo openCloseSettlFlag (tag 286) na mensagem SettlementPrice (269=6) será mantida inicialmente na atualização para o novo dicionário FIX, mas será desativada em um segundo momento, passando a ser necessária a utilização do novo campo settlDate para identificação da data de referência do preço de ajuste;
- Inclusão de novo domínio na tag1482-OptPayoutType (2 - Vanilla - Cash Settlement), na mensagem de SecurityList (35=y);
- Inclusão na mensagem de SecurityList (35=y) de novo domínio na tag 871-InstrAttribType (35 -TEST_INSTRUMENT) para informar que o instrumento é negociável, mas não possui efeito sobre posições, no volume de negociações da bolsa etc. (para uso futuro na identificação dos instrumentos de teste).

As especificações técnicas do UMDF Conflated e novo arquivo de dicionário FIX poderão ser consultados no [site da B3](#) (Soluções > Plataformas > Puma Trading System > UMDF e UMDF Conflated).

4. Cronograma de atualização

As datas de disponibilização nos ambientes de certificação e das etapas da entrada em produção (prevista para quarto trimestre de 2026) estão disponíveis [aqui](#).

Para mais informações entre em contato com as nossas centrais de atendimento.

Central – Atendimento a Operações
+55 (11) 2565-5022
negociacao@b3.com.br

Central – Suporte à Negociação
+55 (11) 2565-5021
suporteanegociacao@b3.com.br

B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão