



BRASIL
BOLSA
BALCÃO

EntryPoint Drop Copy

Roteiro de Certificação

Version: 1.8
Last modified: 25/10/2022

Contato

Trading Certification

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

Índice

ÍNDICE.....	3
HISTÓRICO DE VERSÕES.....	4
1. PREFÁCIO.....	5
2. INTRODUÇÃO.....	6
PRÉ-REQUISITOS	6
A1. LOGON.....	8
A2. HEARTBEAT	8
A3. LOGOUT	8
A4. RESEND REQUEST	9
B1. ORDEM DE COMPRA	10
B2. ORDEM DE VENDA.....	11
B3. DIRETO	12
C1. EXECUÇÃO PARCIAL E TOTAL.....	12
C2. CANCELAMENTO EM DESCONEXÃO	13
C3. EXECUÇÃO TOTAL ON BEHALF	13
D. CRIAÇÃO E NEGOCIAÇÃO DE ESTRATÉGIAS.....	13
E. RLP – RETAIL LIQUIDITY PROVIDER	14
F. H.A. – FALHA NA INSTÂNCIA PRINCIPAL DA APLICAÇÃO	14
G. EDS – EXCHANGE DEFINED STRATEGIES.....	15
H. LIMITAÇÃO DA MENSAGEM DE RETRANSMISSÃO	15

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
27 de fevereiro de 2019	1.4	- Inclusão do Cenário "RLP"	Trading Certification
02 de agosto de 2021	1.5	- Inclusão do Cenário "H.A."	Trading Certification
08 de março de 2022	1.6	- Inclusão do Cenário "EDS - Exchange Defined Strategies"	Trading Certification
14 de março de 2022	1.7	- Atualização do cenário "A1. Logon" - Inclusão do Cenário "Limitação da Mensagem de Retransmissão"	Trading Certification
25 de Outubro de 2022	1.8	- Inclusão do passo "H. Limitação da Mensagem de Retransmissão"	Trading Certification

1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualifica uma instituição de terceiros conectar na B3 com o propósito de rotear ordens no segmento 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)

Este documento explicita o processo de certificação para rotear ordens através do EntryPoint da B3 e é fornecido para terceiros que precisam de conectividade para negociação com a B3.

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

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 B3 em: http://www.b3.com.br/pt_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-desenvolvedores-e-vendors/entrypoint-entrada-de-ofertas/

A1. Logon

Disponível em: PUMA Equities; PUMA Derivativos

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	Cliente: Enviar Logon com informação de senha incorreta (tag 96)	Recebe a mensagem de Logout com rejeição de 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
A1.3	Trading Certification: Alterar o sequencial da sessão para um valor acima do enviado pela sessão do cliente	Recebe a mensagem de Logout com rejeição de Logon, informando que o sequencial enviado foi muito baixo e que era esperado receber o valor informado por Trading Certification	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	<p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=1 e 16=0)</p>	<p>Cliente: Recebe a retransmissão</p> <p>Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.2	<p>Cliente desconecta da Bolsa</p> <p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=101 e 16=0)</p>	<p>Recebe a retransmissão</p> <p>Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.3	<p>Cliente desconecta da Bolsa</p> <p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=201 e 16=0)</p>	<p>Recebe a retransmissão</p> <p>Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.4	<p>Cliente desconecta da Bolsa</p> <p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=301 e 16=0)</p>	<p>Recebe a retransmissão</p> <p>Cliente: Confirma o SeqNum da primeira e da última mensagem</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.5	<p>Cliente desconecta da Bolsa</p> <p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 200 mensagens por 2 sessões de Order Entry distintas (100 em cada sessão)</p> <p>Cliente: Envia o Resend Request das 100 primeiras mensagens (tags 7=401 e 16=0)</p>	<p>Recebe a retransmissão</p> <p>Cliente: Confirma quantas mensagens referentes a cada sessão Order Entry foram recebidas</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.6	<p>TRADING CERTIFICATION: Gera massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Recebe mensagens</p> <p>Cliente: desconecta a sessão</p> <p>TRADING CERTIFICATION: Gera nova massa de 100 mensagens</p> <p>Cliente: Reconecta a sessão</p> <p>Cliente: Envia Resend Request apenas das mensagens faltantes (tags 7=701 e 16=0)</p>	<p>Recebe as mensagens</p> <p>Recebe apenas as mensagens faltantes (tag 34 da última mensagem recebida deve ser igual a tag 34 da última mensagem da massa gerada)</p>	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

B1. Ordem de Compra

Disponível em: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B1.1	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.2	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra	Cliente: Recebe rejeição da oferta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.3	TRADING CERTIFICATION: Enviar alteração de ordem de compra	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.4	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem On Behalf	Cliente: Recebe rejeição do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.5	TRADING CERTIFICATION: Enviar alteração de ordem de compra (On Behalf)	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.6	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento de ordem de compra (On Behalf)	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
B1.7	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra fora do preço	Cliente: Recebe rejeição da oferta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.8	TRADING CERTIFICATION: Enviar alteração de ordem de compra	Recebe o Execution Report de rejeição	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.9	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da oferta	Cliente: Recebe rejeição do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.10	TRADING CERTIFICATION: 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	TRADING CERTIFICATION: 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

B2. Ordem de Venda

Disponível em: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B2.1	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda	Cliente: Recebe o Execution Report	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.2	TRADING CERTIFICATION: Enviar alteração de ordem de venda	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.3	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da oferta	Recebe o Execution Report da alteração	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.4	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem On Behalf	Recebe o Execution Report do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.5	TRADING CERTIFICATION: 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	TRADING CERTIFICATION: 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	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda fora do preço	Cliente: Recebe rejeição da oferta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.8	TRADING CERTIFICATION: Enviar alteração de ordem de venda	Recebe o Execution Report de rejeição	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.9	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da oferta	Cliente: Recebe rejeição do cancelamento	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.10	TRADING CERTIFICATION: 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	TRADING CERTIFICATION: 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

B3. Direto

Disponível em: Equities e Derivativos

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

C1. Execução Parcial e Total

Disponível em: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C1.1	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra LIMITADA DIA de 200 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	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da quantidade restante da ordem de compra enviada no C1.1	Recebe o cancelamento.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.3	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de compra LIMITADA GTD de 200 Envia ordem LIMITADA GTD 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
C1.4	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da quantidade restante da ordem de compra enviada no C1.3	Recebe o cancelamento.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.5	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda LIMITADA DIA de 200 Envia ordem LIMITADA DIA de compra de 100	Recebe execução parcial da ordem de venda Execução total da compra	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.6	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da quantidade restante da ordem de venda enviada no C1.5	Recebe o cancelamento.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.7	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem de venda LIMITADA GTD de 200 Envia ordem LIMITADA GTD de compra de 100	Recebe execução parcial da ordem de venda Execução total da compra	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.8	TRADING CERTIFICATION: Enviar cancelamento da quantidade restante da ordem de venda enviada no C1.3	Recebe o cancelamento.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C2. Cancelamento em Desconexão

Disponível em: Equities
Modelo de acesso: DMA

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C2.1	TRADING CERTIFICATION: LOGON CoD TIPO 3 na Sessão Order Entry TRADING CERTIFICATION: Envia 1 ordem DIA e 1 ordem GTC na Sessão Order Entry TRADING CERTIFICATION: Força a desconexão da Sessão Order Entry	Cliente: Recebe Execution Report de entrada das ordens Recebe o cancelamento da ordem DIA ativado pelo CoD	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C3. Execução Total On Behalf

Disponível em: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C3.1	TRADING CERTIFICATION: Insere um negócio	Cliente: Recebe execução do negócio.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

D. Criação e Negociação de Estratégias

Disponível em: Equities
Modelos de acesso: Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
D.1	TRADING CERTIFICATION: Enviar ordem em Instrumento de estratégia com DUAS patas	CLIENTE recebe o Execution Report	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D.2	TRADING CERTIFICATION: Enviar negócio realizado com a UDS (Estratégia)	CLIENTE recebe 1 Execution Report para UDS e 1 por pata	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

E. RLP – Retail Liquidity Provider

Tags: 40=W (RLP) ; 35487=1 (RLT); 35487=2 (Waived Priority)
 Disponível em: PUMA Equities; PUMA Derivativos
 Modelos de acesso: Mesa e DMA
 Cliente deve utilizar conta: 123

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status
E.1	Cliente: Enviar Oferta de Compra RLP, Quantidade: 1000, não informar Preço. Cliente: Enviar Oferta de Venda RLP, Quantidade: 1000, não informar Preço.	Recebe Execution Report com a tag 40=W (RLP)	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
E.2	Trading Certification: Enviar Ofertas: Compra: Quantidade 100@35,00 Venda: Quantidade 100@35,05 Cliente: Enviar Oferta de Compra a Varejo (RLT), Quantidade: 100@35,05	Recebe Execution Report com a tag 35487=1 (RLT) Execução Parcial da Oferta RLP (100@35,05), saldo remanescente de 900 da Oferta RLP.	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
E.3	Cliente: Enviar oferta de Compra Waived Priority, Quantidade: 100@35,00 Trading Certification: Enviar oferta de Venda Limitada, Quantidade: 100@35,00	Recebe Execution Report com a tag 35487=2 (Waived Priority) Recebe Execution Report de Execução Total com a tag 35487=2	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E

F. H.A. – Falha na instância principal da aplicação

Disponível em: PUMA Equities; PUMA Derivativos
 Modelos de acesso: Mesa e DMA

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status
F.1	Cliente: Enviar 10 Ofertas de compra limitada, DIA • 100@20,00	Recebe 10 Execution Report's	S	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
Trading Certification: Executa o processo que irá simular falha na instância principal para que o DropCopy suba na instância de H.A. Obs: O tempo configurado para que a instância de H.A. suba no ambiente de certificação é de 30 segundos (esse valor pode ser diferente do ambiente de produção).				
F.2	Cliente: Reconectar a sessão de Drop Copy antes da virada estar concluída (tempo menor que 30 segundos)	Cliente: Não consegue reconectar	S	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
F.3	Cliente: Reconectar a sessão de Drop Copy	Cliente: Reconecta e o SequenceNumber é incrementado corretamente	S	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
F.4	Cliente: Enviar 10 Ofertas de compra limitada, DIA 100@20,00	Cliente: Recebe 10 Execution Report's	S	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
F.5	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	S	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
F.6	Trading Certification: Enviar cancelamento das 10 ofertas de compra limitada, DIA	Cancelamento das ofertas pendentes	S	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
F.7	Cliente: Envia o Resend Request de todas as mensagens	Cliente: Recebe a retransmissão Cliente: Confirma o SequenceNumber da primeira e da última mensagem	S	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E

G. EDS – Exchange Defined Strategies

Disponível em: PUMA Derivativos
Modelos de acesso: Mesa e DMA

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
G.1	Trading Certification: Enviar oferta de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 10@10,00 Trading Certification: Enviar oferta de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 10@10,00 	Recebimento de Execution Reports de confirmação das ofertas de compra e de venda Recebimento de Execution Reports de negócio, do lado de compra e de venda do instrumento de EDS e de cada uma das patas, validando as tags 442 = 3 (EDS) e 442 = 2 (Patas)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
G.2	Trading Certification: Enviar o cancelamento do negócio gerado	Recebimento de 6 Execution Reports de cancelamento dos negócios de compra e venda para o instrumento de EDS e para cada uma das patas, validando as tags 442 = 3 (EDS), 442 = 2 (Patas) e 150=H	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
G.3	Trading Certification: Enviar oferta de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 10@10,00 Trading Certification: Enviar o cancelamento da oferta de compra limitada, DIA através do Firmsoft (Sistema da B3)	Recebimento de Execution Report de confirmação da oferta de compra Recebimento de Execution Report de cancelamento da oferta de compra, validando a tag 378 = 105	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
G.4	Trading Certification: Enviar ordem cross limitada, DIA (35=s)	Recebimento de Execution Reports de confirmação das ofertas de compra e de venda, validando a tag 548 Recebimento de Execution Reports de negócio, do lado de compra e de venda do instrumento de EDS e de cada uma das patas, validando as tags 442 = 3 (EDS) e 442 = 2 (Patas)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

H. Limitação da Mensagem de Retransmissão

Disponível em: PUMA Equities; PUMA Derivativos
Modelos de acesso: Mesa e DMA

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
H.1	Cliente: Solicitar a retransmissão de uma quantidade de mensagens maior que o limite de certificação.	Recebimento mensagem de rejeição (35=3) informando que foi ultrapassado o limite máximo de mensagens	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
H.2	Cliente: Solicitar a retransmissão simultânea.	Recebimento mensagem de rejeição (35=3) informando que apenas uma retransmissão pode ser solicitada por vez.	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
H.3	Cliente: Solicitar a retransmissão simultânea.	Recebimento de mensagem de desconexão (35=5) informando que foi ultrapassado o limite de solicitações de retransmissão simultânea	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E