

EntryPoint

Roteamento de ordem

Roteiro de Certificação

Versão: 4.5

Última modificação: 30/07/2015



Contato

Centro de testes e Certificação - CTC

- ctc@bvmf.com.br
- +55 11 2565-5500

Índice

HISTÓRICO DE VERSÕES	4
1. PREFÁCIO	5
2. INTRODUÇÃO	6
PRÉ-REQUISITOS	6
3. GLOSSÁRIO	7
A1. ORDENS LIMITADA COM VALIDADE DIA	8
A2. ORDENS LIMITADA COM VALIDADE GTC	9
A3. ORDENS LIMITADA COM VALIDADE IOC/FAK	10
A4. ORDENS LIMITADA COM VALIDADE GTD	11
A5. ORDENS LIMITADA COM VALIDADE FOK	12
B1. ORDENS A MERCADO LIMITADA COM VALIDADE DIA	13
B2. ORDENS A MERCADO LIMITADA COM VALIDADE GTC	14
B3. ORDENS A MERCADO LIMITADA COM VALIDADE IOC/FAK	15
B4. ORDENS A MERCADO LIMITADA COM VALIDADE GTD	16
B5. ORDENS A MERCADO LIMITADA COM VALIDADE FOK	17
C1. ORDENS A MERCADO COM PROTEÇÃO COM VALIDADE DIA	18
C2. ORDENS A MERCADO COM PROTEÇÃO COM VALIDADE GTC	19
C3. ORDENS A MERCADO COM PROTEÇÃO COM VALIDADE IOC/FAK	20
C4. ORDENS A MERCADO COM PROTEÇÃO COM VALIDADE GTD	21
C5. ORDENS A MERCADO COM PROTEÇÃO COM VALIDADE FOK	22
C6. ORDENS MARKET ON AUCTION	23
D1. ORDENS STOP LIMITADA COM VALIDADE DIA	24
D2. ORDENS STOP LIMITADA COM VALIDADE GTC	25
D3. ORDENS STOP LIMITADA COM VALIDADE GTD	26
E1. ORDENS STOP COM PROTEÇÃO COM VALIDADE DIA	27
E2. ORDENS STOP COM PROTEÇÃO COM VALIDADE GTC	28
E3. ORDENS STOP COM PROTEÇÃO COM VALIDADE GTD	29
F. ORDEM DE REPASSE	30
G. ORDEM DIRETA COM VALIDADE DIA	31
H. ORDENS COM MODIFICAÇÃO DE CONTA	32
I. REGISTRO DE ORDENS COM QUANTIDADE MÍNIMA	33
J. REGISTRO DE ORDENS COM QUANTIDADE APARENTE	34
K. ORDENS COM INSTRUMENTO RESERVADO	35
M. ORDENS EM CENÁRIO DE ALTA FREQUÊNCIA	36
N. ORDENS MARKET ON CLOSE	37
O. ENTRYPOINT LINE	38
P. SELF TRADE PREVENTION	39
Q. OPERAÇÕES DE MERCADO - TRADE ON BEHALF	41
R1. TERMO	42
R2. TERMO CASH	44
R3. TERMO VISTA REGISTRADO	46
S1. EXERCÍCIO E BLOQUEIO	47
S2. REGISTRO DE EXERCÍCIO AUTOMÁTICO	48
T. CANCELAMENTO EM DESCONEXÃO	49
U. CRIAÇÃO E NEGOCIAÇÃO DE ESTRATÉGIAS	52
V. MESSAGE REPLAY	54
W. MARKET MAKER PROTECTION	55

Histórico de Versões

Data	Versão	Descrição	Autor
30 de Julho de 2015	4.5	- Inclusão do Cenário "Registro de Exercício Automático"	DC CTC
07 de Abril de 2015	4.4	- Inclusão do Cenário "Market Maker Protection"	DC CTC
12 de dezembro de 2013	4.3	- Alteração de cenário "Stop com Proteção" - Remoção de cenário para "Instrumento Congelado" - Cenário "Ordem Direta" disponível para DMA no segmentos de Equities	CTC AMS
04 de março de 2013	4.2	- Adaptação do roteiro para Certificação automatizada via MyCTC	CTC
21 de novembro de 2012	4.1	- Corrigido os cenários de "Self trade Prevention" - Corrigido cenário de "Market on Auction" - Corrigido o cenário de "Trade on Behalf" - Corrigido Obrigatoriedade do cenário "Modificação de conta"	JMCGA CTC
15 de setembro de 2012	4.0	- Inclusão para o New Release: Cenários C; E; Q	JMCGA CTC
27 de agosto de 2012	3.5	- Correção do cenário "Ordens limitada com validade dia" - Correção do cenário "Registro de Ordens com Instrumento Congelado"	DCG CTC
14 de agosto de 2012	3.4	- Alteração da ordem do cenário de Line - Alteração do cenário de Termo - Alteração do cenário de E&B - Alteração do cenário de Self-Trade Prevention - Remoção do cenário "GTSClient Drop Copy" - Alteração do cenário "Registro de Ordens com Instrumento Reservado" - Alteração do cenário de Market on Auction	DCG CTC
21 de junho de 2012	3.3	- Corrigido cenário de self-trade prevention - Retirado o cenário de mensagem de sessão - Incluído o cenário C6 para equities - Alterado a obrigatoriedade do cenário A5.3 - Correção do cenário de repasse	JMCGA CTC
09 de maio de 2012	3.2	- Incluído nota sobre a indisponibilidade dos tipos de ordem 40=1 e 40=3 - Movido o cenário de resend request do A2.8 para o A1.8 pois o mesmo passa ser obrigatório - Corrigido cenário de LINE para adequar as quantidades a Mega EntryPoint e EntryPoint Derivativos e Adicionado os tipos de rejeição - Adição do cenário de mensagens de sessão - Correção dos cenários de Self Trade Prevention - Corrigidos os cenários de Cancel On Disconnect	JMCGA CTC
11 de janeiro de 2012	3.1	- Criação do documento	AMS CTC

1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualifica uma instituição de terceiros conectar na BM&FBOVESPA 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 BM&FBOVESPA e é fornecido para terceiros que precisam de conectividade para negociação com a BM&FBOVESPA.

Para requisitar cópias desse documento, favor contatar: ctc@bvmf.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 BM&FBOVESPA em <http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/servicos/solucoes-para-negociacao/plataformas-de-negociacao/entrypoint.aspx?idioma=pt-br>

3. Glossário

DATADA	Datada
VAC	Válida Até Cancelar
EOC	Executa Ou Cancela
TON	Tudo Ou Nada
ATC	At The Close
GFA	Good For Auction
HFT	High Frequency Trader
GTC	Good Till Cancel; O mesmo que VAC
GTD	Good Till Date; O mesmo que DATADA
FOK	Fill Or Kill; o mesmo que TON
FAK	Fill And Kill; o mesmo que EOC

A1. Ordens LIMITADA com validade DIA Tags: 35=D; 40=2; 59=0 Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A1.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@20,00	Execução total das ordens - Negócio gerado	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.2	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@20,00	Execução parcial das ordens - Negócio gerado Ordens no book: • Compra 100@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.3	Cliente: Modificar ordem de compra pendente • De: 100@20,00 • Alterar para: 300@21,00	Modificação da ordem pendente no book Ordens no book: • Compra 200@21,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.4	CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@21,00	Execução parcial da ordem modificada - Negócio gerado Ordens no book: • Compra 100@21,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.5	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente • Quantidade book: 100@21,00	Cancelamento da ordem pendente.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.6	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@21,00	Ordens no book: • Compra 200@20,00 • Venda 100@21,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.7	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente • De: 100@21,00 • Alterar para: 300@20,00	Execução parcial da ordem modificada - Negócio gerado Ordens no book: • Venda 100@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.8	Cliente: Encerrar conexão com a Bolsa	Receber mensagem 35=5 de logout.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.9	CTC: Enviar cancelamento de ordem de venda limitada, DIA	Cancelamento da ordem pendente	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.10	Cliente: Entrar no sistema com campo 141 = N (números de sequência não devem ser reiniciados) Cliente: enviar mensagem de resend request	As ordens que não foram enviadas não devem ser transmitidas à Bolsa. Mensagens Execution Report são retransmitidas	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A1.11	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

A2. Ordens LIMITADA com validade GTC Tags: 35=D; 40=2; 59=1 Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A2.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.2	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução parcial das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.3	Cliente: Enviar modificação da ordem de compra pendente <ul style="list-style-type: none"> De: 100@20,00 Alterar para: 300@21,00 	Modificação da ordem pendente no book Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 200@21,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.4	CTC: Enviar ordem de venda limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 	Execução parcial da ordem modificada Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@21,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.5	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.6	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 	Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 200@20,00 Venda 100@21,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.7	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente <ul style="list-style-type: none"> De: 100@21,00 Alterar para: 300@20,00 	Execução parcial da ordem modificada: Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Venda 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.8	CTC: Enviar cancelamento de ordem de venda limitada, GTC	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A2.9	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

A3. Ordens LIMITADA com validade IOC/FAK Tags: 35=D; 40=2; 59=3 Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A3.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, IOC/FAK • 100@20,00	Cancelamento imediato da ordem	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A3.2	CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, IOC/FAK • 200@20,00	Execução parcial das ordens. • Negócio gerado. Quantidade pendente cancelada: • Compra 100@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A3.3	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar modificação da ordem de compra para validade IOC/FAK	Execução de modificação de ordem: • Oferta cancelada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A3.4	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, IOC/FAK • 100@20,00	Execução total das ordens. • Negócio gerado. Quantidade pendente : • Compra 100@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A3.5	Cliente: Enviar ordem de venda limitada, IOC/FAK • 100@20,00	Execução total das ordens. • Negócio gerado.	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A3.6	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

A4. Ordens LIMITADA com validade GTD Tags: 35=D; 40=2; 59=6 Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A4.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTD <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.2	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTD <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, GTD <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução parcial das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.3	Cliente: Enviar modificação da ordem de compra pendente <ul style="list-style-type: none"> De: 100@20,00 Alterar para: 300@21,00 	Modificação da ordem pendente no book Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 200@21,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.4	CTC: Enviar ordem de venda limitada, GTD <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 	Execução parcial da ordem modificada: Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@21,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.5	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.6	CTC: Enviar ordem de compra limitada, GTD <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, GTD <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 	Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 200@20,00 Venda 100@21,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.7	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente <ul style="list-style-type: none"> De: 100@21,00 Alterar para: 300@20,00 	Execução parcial da ordem modificada: Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Venda 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.8	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTD com data antiga : <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Rejeição da ordem	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.9	CTC: Enviar cancelamento de ordem de venda limitada	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A4.10	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

A5. Ordens LIMITADA com validade FOK Tags: 35=D; 40=2; 59=4 Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
A5.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, FOK • 100@20,00	Cancelamento imediato da ordem.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A5.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, FOK • 200@20,00	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A5.3	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, FOK • 400@20,00	Cancelamento imediato da ordem.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
A5.4	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

B1. Ordens a MERCADO LIMITADA com validade DIA

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

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B1.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, DIA • 100@Mercado	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, DIA • 100@Mercado	Execução total das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: • Compra 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.3	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, DIA • 200@Mercado	Execução parcial da ordem. Negócio gerado Ordens no book: • Venda 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.4	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente • 100@20,00	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.5	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@21,00	Ordens no book: • Compra 200@20,00 • Venda 100@21,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.6	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda limitada, DIA • De: 100@21,00 • Alterar para: 200@Mercado	Execução total da ordem modificada: Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.7	CTC: Enviar ordens de compra limitada, DIA • 100@20,00 • 100@21,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, DIA • 200@Mercado	Execução parcial da ordem. Negócio gerado. Ordens no book: • Compra 100@20,00 • Venda 100@21,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.8	CTC: Enviar cancelamento de ordem de compra e venda limitada, DIA, incluindo ordem do cliente	Cancelamento da(s) ordem(ns) pendente(s)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B1.9	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

B2. Ordens a MERCADO LIMITADA com validade GTC

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

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B2.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTC • 100@Mercado	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTC • 100@Mercado	Execução total das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: Compra 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.3	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTC • 200@Mercado	Execução parcial da ordem. Negócio gerado Ordens no book: • Venda 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.4	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente • 100@20,00	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.5	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, GTC • 100@21,00	Ordens no book: • Compra 200@20,00 • Venda 100@21,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.6	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda limitada, GTC • De: 100@21,00 • Alterar para: 200@Mercado	Execução total da ordem modificada: Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.7	CTC: Enviar ordens de compra limitada, DIA • 100@20,00 • 100@21,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTC • 200@Mercado	Execução parcial da ordem. Negócio gerado. Ordens no book: • Compra 100@20,00 • Venda 100@21,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.8	CTC: Enviar cancelamento de ordem de compra e venda limitada, GTC, incluindo ordem do cliente	Cancelamento da(s) ordem(ns) pendente(s).	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B2.9	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

B3. Ordens a MERCADO LIMITADA com validade IOC/FAK

Tags: 35=D; 40=K; 59=3

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B3.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, IOC/FAK • 100@Mercado	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B3.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, IOC/FAK • 200@Mercado	Execução parcial das ordens. • Negócio gerado. Cancelamento da ordem pendente	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B3.3	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@21,00 Cliente: Enviar modificação da ordem de Venda para validade a mercado, IOC/FAK	Execução de modificação de ordem Execução total das ordens - Negócio gerado	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B3.4	CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra a mercado, IOC/FAK • 300@Mercado	Execução parcial das ordens. • Negócio gerado. Oferta (qtd 200) cancelada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B3.5	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

B4. Ordens a MERCADO LIMITADA com validade GTD

Tags: 35=D; 40=K; 59=6

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B4.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, GTD • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTD • 100@Mercado	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B4.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, GTD • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTD • 200@Mercado	Execução parcial das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: • Venda 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B4.3	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente • De: 100@20,00 • Alterar para: 300@Mercado	Rejeição da modificação da ordem, pois não há contraparte.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B4.4	CTC: Enviar ordem de compra limitada, GTD • 100@21,00	Execução total da ordem. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B4.5	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTD • 100@Mercado	Rejeição da ordem, pois não há contraparte.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B4.6	CTC: Enviar ordem de compra limitada, GTD • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, GTD • 200@Mercado	Execução parcial Ordens no book: • Venda 100@20.00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B4.7	CTC: Enviar cancelamento de ordem de venda	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B4.8	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

B5. Ordens a MERCADO LIMITADA com validade FOK

Tags: 35=D; 40=K; 59=4

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
B5.1	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, FOK • 200@Mercado	Oferta rejeitada, pois não há contra parte.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B5.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, FOK • 100@Mercado	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B5.3	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, FOK • 200@Mercado	Oferta aceita e em seguida cancelada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
B5.4	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C1. Ordens a MERCADO COM PROTEÇÃO com validade DIA					
Tags: 35=D; 40=1; 59=0					
Disponível em: PUMA Equities;					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
CTC: Ajustar o ponto de proteção para 1,00					
C1.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, DIA <ul style="list-style-type: none">100@Mercado com proteção	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, DIA <ul style="list-style-type: none">100@Mercado com proteção	Execução total das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.3	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, DIA <ul style="list-style-type: none">200@Mercado com proteção	Execução parcial da ordem. Negócio gerado Ordens no book: Venda 100@19,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.4	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente <ul style="list-style-type: none">100@19,00	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.5	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@21,00	Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@20,00Venda 100@21,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.6	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">De: 100@21,00Alterar para: 200@Mercado com proteção	Execução total da ordem modificada: Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.7	CTC: Enviar ordens de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@20,00100@21,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, DIA <ul style="list-style-type: none">200@Mercado com proteção	Execução parcial da ordem seguido da execução total da ordem. Negócios gerados.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.8	CTC: Enviar ordens de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@20,00100@22,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, DIA <ul style="list-style-type: none">200@Mercado com proteção	Execução parcial da ordem. Negócios gerados. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Venda 100@21,00Compra 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.9	CTC: Enviar cancelamento de ordens	Cancelamento da(s) ordem(ns) pendente(s).	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C1.10	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C2. Ordens a MERCADO COM PROTEÇÃO com validade GTC Tags: 35=D; 40=1; 59=1 Disponível em: PUMA Equities;					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C2.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, GTC <ul style="list-style-type: none"> 100@Mercado com proteção 	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, GTC <ul style="list-style-type: none"> 100@Mercado com proteção 	Execução total das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.3	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, GTC <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado com proteção 	Execução parcial da ordem. Negócio gerado Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Venda 100@19,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.4	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente <ul style="list-style-type: none"> 100@19,00 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.5	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 	Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 200@20,00 Venda 100@21,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.6	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> De: 100@21,00 Alterar para: 200@Mercado com proteção 	Execução total da ordem modificada: Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.7	CTC: Enviar ordens de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 100@21,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, GTC <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado com proteção 	Execução parcial da ordem seguido da execução total da ordem. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.8	CTC: Enviar ordens de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 100@22,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, GTC <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado com proteção 	Execução parcial da ordem. Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Venda 100@21,00 Compra 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.9	CTC: Enviar cancelamento de ordens	Cancelamento da(s) ordem(ns) pendente(s).	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C2.10	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C3. Ordens a MERCADO COM PROTEÇÃO com validade IOC/FAK Tags: 35=D; 40=1; 59=3 Disponível em: PUMA Equities;					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C3.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, IOC/FAK • 100@Mercado com proteção	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C3.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, IOC/FAK • 100@Mercado com proteção	Execução total das ordens – Negócio gerado. Ordens no book: • Compra 100@20,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C3.3	Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@21,00 Cliente: Enviar modificação da ordem de venda para tipo Mercado com proteção, IOC/FAK	Execução total das ordens. • Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C3.4	CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra a mercado com proteção, IOC/FAK • 300@Mercado com proteção	Execução parcial das ordens. • Negócio gerado. Oferta (qtd 200) cancelada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C3.5	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C4. Ordens a MERCADO COM PROTEÇÃO com validade GTD					
Tags: 35=D; 40=1; 59=6 Disponível em: PUMA Equities;					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C4.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, GTD • 100@Mercado com proteção	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, GTD • 200@Mercado com proteção	Execução parcial das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: • Venda 100@19,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.3	Cliente: Enviar modificação da ordem de compra pendente • De: 100@19,00 • Alterar para: 300@22,00	Modificação da ordem pendente no book Ordens no book: • Venda 200@22,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.4	CTC: Enviar ordem de compra limitada, GTD • 100@22,00	Execução parcial da ordem modificada. Negócio gerado. Ordens no book: • Venda 100@22,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.5	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente • 100@22,00	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.6	CTC: Enviar ordem de compra limitada, GTD • 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, GTD • 100@21,00	Ordens no book: • Compra 200@20,00 • Venda 100@21,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.7	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente • De: 100@21,00 • Alterar para: 200@Mercado com proteção	Execução total da ordem modificada. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.8	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTD com data anterior à atual • 100@20,00	Rejeição de ordens.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C4.9	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C5. Ordens a MERCADO COM PROTEÇÃO com validade FOK Tags: 35=D; 40=1; 59=4 Disponível em: PUMA Equities;					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
C5.1	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção, FOK <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado com proteção 	Oferta é rejeitada, pois não a contraparte	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C5.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção com proteção, FOK <ul style="list-style-type: none"> 100@Mercado com proteção 	Execução total das ordens. Negócio gerado. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C5.3	Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção com proteção, FOK <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado com proteção 	Cancelamento imediato da ordem.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C5.4	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 Cliente: Enviar ordem de venda a mercado com proteção com proteção, FOK <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado com proteção 	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C5.5	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

C6. Ordens MARKET ON AUCTION Tags: 35=D; 40=1; 59=A Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
CTC: Mudança de estado de mercado para Leilão (Reservado)					
C6.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda GFA <ul style="list-style-type: none">100@MOA	Registro das ordens. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 100@20,00Venda 100@MOA	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C6.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">200@21,00 Cliente: Enviar ordem de venda GFA <ul style="list-style-type: none">200@MOA	Registro das ordens. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@21,00Compra 100@20,00Venda 300@MOA	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
CTC: Mudar estado de mercado para Aberto					
C6.3	CTC: Muda estado de Mercado	Execução total das ordens MOA. Preço de abertura: 21,00	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
C6.4	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

D1. Ordens STOP LIMITADA com validade DIA

Tags: 35=D; 40=4; 59=0

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
D1.1	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,10 Preço stop: 22,00 <p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 <p>CTC: Gera um negócio com preço 22,00</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 <p>CTC: Gera um negócio com preço 22,10</p>	Registro das ordens com posterior disparo e execução total	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D1.2	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 200@22,30 Preço stop: 22,20 <p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,20 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,20 <p>CTC: Gera um negócio com preço 22,20</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,20 <p>CTC: Gera um negócio com preço 22,30</p>	<p>Registro das ordens com posterior disparo e execução parcial</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@22,30 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D1.3	<p>Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,30 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D1.4	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

D2. Ordens STOP LIMITADA com validade GTC Tags: 35=D; 40=4; 59=1 Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
D2.1	Cliente: Enviar ordem de compra STOP, GTC <ul style="list-style-type: none"> 100@23,10 Preço stop: 23,00 CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@23,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@23,00 CTC: Gera um negócio com preço 23,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@23,00 CTC: Gera um negócio com preço 23,10	Registro das ordens com posterior disparo e execução total	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D2.2	Cliente: Enviar ordem de compra STOP, GTC <ul style="list-style-type: none"> 200@23,30 Preço stop: 23,20 CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@23,20 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@23,20 CTC: Gera um negócio com preço 23,20 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@23,20 CTC: Gera um negócio com preço 23,30	Registro das ordens com posterior disparo e execução parcial Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@23,30 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D2.3	Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente <ul style="list-style-type: none"> 100@23,30 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D2.4	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

D3. Ordens STOP LIMITADA com validade GTD

Tags: 35=D; 40=4; 59=6

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
D3.1	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP, GTD</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,10 Preço stop: 25,00 <p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,00 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,00 <p>CTC: Gera um negócio com preço 25,00</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,00 <p>CTC: Gera um negócio com preço 25,10</p>	Registro das ordens com posterior disparo e execução total	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D3.2	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP, GTD</p> <ul style="list-style-type: none"> 200@25,30 Preço stop: 25,20 <p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,20 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,20 <p>CTC: Gera um negócio com preço 25,20</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,30 <p>CTC: Gera um negócio com preço 25,30.</p>	<p>Registro das ordens com posterior disparo e execução parcial</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@25,30 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D3.3	<p>Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@25,30 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
D3.4	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

E1. Ordens STOP COM PROTEÇÃO com validade DIA

Tags: 35=D; 40=3; 59=0
Disponível em: PUMA Equities

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
CTC: Ajustar o ponto de proteção para 1,00					
E1.1	Cliente: Enviar ordem de compra STOP COM PROTEÇÃO, DIA <ul style="list-style-type: none">Quantidade: 100Preço stop: 27,00 CTC: Altera valor de proteção	Registro de nova ordem e <i>restatement</i> de preço de proteção	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E1.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@27,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@27,00 CTC: Gera um negócio com preço 27,00CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@27,00 CTC: Gera um negócio com preço 28,10	Disparo e execução total da ordem enviada no cenário E1.1	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E1.3	Cliente: Enviar ordem de compra STOP COM PROTEÇÃO, DIA <ul style="list-style-type: none">Quantidade: 200Preço stop: 28,10 CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@28,10 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@28,10 CTC: Gera um negócio com preço 28,10CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@28,10 CTC: Gera um negócio com preço 29,10	Registro das ordens com posterior disparo e execução parcial Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 100@29,10	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E1.4	Cliente: Envia cancelamento da ordem pendente <ul style="list-style-type: none">100@29,10	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E1.5	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

E2. Ordens STOP COM PROTEÇÃO com validade GTC

Tags: 35=D; 40=3; 59=1
Disponível em: PUMA Equities

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
E2.1	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP COM PROTEÇÃO, GTC</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade 100 Preço stop: 29,20 <p>CTC: Altera valor de proteção</p>	Registro de nova ordem e <i>restatement</i> de preço de proteção	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E2.2	<p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@29,20 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@29,20 <p>CTC: Gera um negócio com preço 29,20</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@29,20 <p>CTC: Gera um negócio com preço 30,30</p>	Disparo e execução total da ordem enviada no cenário E2.1	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E2.3	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP COM PROTEÇÃO, GTC</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade: 200 Preço stop: 30,30 <p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@30,30 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@30,30 <p>CTC: Gera um negócio com preço 30,30</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@30,30 <p>CTC: Gera um negócio com preço 31,30</p>	<p>Registro das ordens com posterior disparo e execução parcial</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@31,30 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E2.4	<p>Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@31,30 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E2.5	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

E3. Ordens STOP COM PROTEÇÃO com validade GTD

Tags: 35=D; 40=3; 59=6
Disponível em: PUMA Equities

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
E3.1	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP COM PROTEÇÃO, GTD</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade: 100 Preço stop: 31,40 <p>CTC: Altera valor de proteção</p>	Registro de nova ordem e <i>restatement</i> de preço de proteção	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E3.2	<p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@31,40 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <p>100@31,40</p> <p>CTC: Gera um negócio com preço 31,40</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@31,40 <p>CTC: Gera um negócio com preço 32,40</p>	Disparo e execução total da ordem enviada no cenário E3.1	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E3.3	<p>Cliente: Enviar ordem de compra STOP COM PROTEÇÃO, GTD</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade: 200 Preço stop: 32,50 <p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@32,50 <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@32,50 <p>CTC: Gera um negócio com preço 32,50</p> <p>CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@32,50 <p>CTC: Gera um negócio com preço 33,50</p>	<p>Registro das ordens com posterior disparo e execução parcial</p> <p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@33,50 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E3.4	<p>Cliente: Enviar cancelamento da ordem pendente</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@33,50 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
E3.5	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

F. Ordem de Repasse Tags: 35=D; 581=40 Disponível em: PUMA Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
F.1	Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • 200@20,00 • Conta = 9898 • Tipo de Conta = 40 • SenderLocation = BVMF • Entering Trader válido 	Entrada de ordem	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

G. Ordem Direta com validade DIA Tag: 35=s Disponível em: Puma Derivativos; PUMA Equities; Modelos de acesso: Mesa (DMA somente para Equities)					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
G.1	Cliente: Enviar ordem cross limitada, DIA com SenderLocation BVMF e Entering Trader válido <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução total das ordens. Negócio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
G.2	Cliente: Enviar ordem cross limitada, DIA com SenderLocation BVMF e Entering Trader inválido <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Ordem rejeitada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
G.3	Cliente: Enviar ordem cross limitada, DIA SenderLocation DMA e Entering Trader válido <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Ordem rejeitada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
G.4	CTC: Enviar cancelamento do(s) negócio(s)	Cancelamento de negócio	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

H. Ordens com Modificação de Conta Tag: 35=G; Disponível em: PUMA Equities Modelos de acesso: SOMENTE Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
H.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Registro de ordem de compra Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@20,00 	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
H.2	Cliente: Modificar conta da ordem enviada	Modificação da conta	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
H.3	Cliente: Enviar ordem de venda (nova conta) limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução total da ordem	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

I. Registro de Ordens com Quantidade Mínima

Tag: 110

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

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
I.1	CTC: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade mínima: 100 	Execução parcial e total da ordem	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
I.2	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade mínima: 100 	Ordem aceita e cancelada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
I.3	CTC: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade mínima: 100 	Execução parcial e total do negócio.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
I.4	CTC: Enviar 1 ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, IOC/FAK <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade mínima: 100 	Execução parcial do negócio. Cancelamento da ordem.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
I.5	CTC: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTD <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade mínima 100 	Execução parcial e total do negócio.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

J. Registro de Ordens com Quantidade Aparente

Tag: 111

Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos

Modelos de acesso: DMA e Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
J.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade aparente: 100 CTC: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução parcial e total da ordem	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
J.2	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTC <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade aparente: 100 CTC: Enviar 2 ordens de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Execução parcial e total da ordem	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
J.3	CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Quantidade aparente: 100 	Execução parcial da ordem. Oferta no book <ul style="list-style-type: none"> Compra 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
J.4	CTC: Enviar cancelamento da ordem pendente <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Cancelamento da ordem pendente.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

K. Ordens com Instrumento Reservado					
Tags: 35=D; 40=2;					
Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos					
Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
CTC: Muda o estado do instrumento para Pré-Open (Reservado)					
K.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">200@20,00 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">200@20,00	Registro das ordens com execução na abertura do instrumento Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@20,00Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.2	Cliente: Modificar quantidade da ordem <ul style="list-style-type: none">100@20,00	Rejeição de modificação Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@20,00Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.3	Cliente: Cancelar a ordem de compra	Rejeição de cancelamento Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@20,00Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.4	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">200@19,00	Registro da ordem Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@20,00Compra 200@19,00Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.5	Cliente: Modificar preço da ordem (Compra: 19,00) <ul style="list-style-type: none">200@19,50	Registro de modificação da ordem Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@20,00Compra 200@19,50Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.6	Cliente: Cancelar a ordem de compra (19,50)	Cancelamento da ordem Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@20,00Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.7	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">200@21,00	Registro da ordem. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@21,00Compra 200@20,00Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.8	Cliente: Cancelar ordem de compra <ul style="list-style-type: none">200@20,00	Cancelamento da ordem Ordens no book: <ul style="list-style-type: none">Compra 200@21,00Venda 200@20,00	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.9	CTC: Modificar o estado do instrumento para Aberto	Execução total do negócio	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
K.10	CTC: Enviar cancelamento do negócio	Negócios cancelados	S	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

M. Ordens em Cenário de Alta Frequência Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
M.1	Cliente: Enviar 10 ordens por segundo durante 30 segundos	Entrada de 300 ordens depois dos 30 segundos	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

N. Ordens MARKET ON CLOSE Disponível em: PUMA Equities					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
N.1	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de venda ATC <ul style="list-style-type: none"> 100@MOC 	Registro das ordens. Ordens no book: Compra 100@20,00 Venda 100@MOC	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
N.2	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@21,00 Cliente: Enviar ordem de venda ATC <ul style="list-style-type: none"> 200@MOC 	Registro das ordens. Ordens no book: <ul style="list-style-type: none"> Compra 200@21,00 Compra 100@20,00 Venda 300@MOC 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
CTC: Configurar Closing Call e alterar estado do Mercado para Fechado					
N.3	CTC: Muda estado de Mercado	Execução total das ordens ATC. Preço de abertura: 21,00 Ordens no book são canceladas.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
N.4	CTC: Enviar cancelamento de negócios	Cancelamento dos negócios gerados	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

O. EntryPoint Line					
Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
O.1	Envia ordem de compra (1º Ativo) 500@24	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.2	Envia ordem de compra (1º Ativo) 1500@24	Mensagem de rejeição de registro de ordem por limite de boleta (TCI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.3	Envia ordem de compra (1º Ativo) 1000@24	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.4	Envia ordem de compra (1º Ativo) 1000@24	Mensagem de rejeição de registro de ordem por limite por ativo (LCI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.5	Envia ordem de compra (1º Ativo) 500@24	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.6	Modifica ordem de compra (O.3) 1500@24	Mensagem de rejeição de modificação de ordem por limite por boleta (TCI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.7	Modifica ordem de compra (O.1) 1000@24	Mensagem de rejeição de modificação de ordem por limite por ativo (LCI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.8	Cancela ordem de compra (O.5) 500@24	Mensagem de cancelamento de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.9	Envia ordem de compra (2º Ativo) 1000@30	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.10	Envia ordem de compra (2º Ativo) 600@30	Mensagem de rejeição de registro de ordem por instrumento equivalente (LCC)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.11	Envia ordem de compra (2º Ativo) 100@30	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.12	Modifica ordem de compra (O.11) 1000@30	Mensagem de rejeição de registro de ordem por instrumento equivalente (LCC)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.13	Cancela todas as ordens de compra para 1º e 2º Ativos	Mensagens de cancelamento de ordens	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.14	Envia ordem de venda (1º Ativo) 500@24	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.15	Envia ordem de venda (1º Ativo) 1500@24	Mensagem de rejeição de registro de ordem por limite de boleta (TVI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.16	Envia ordem de venda (1º Ativo) 1000@24	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.17	Envia ordem de venda (1º Ativo) 1000@24	Mensagem de rejeição de registro de ordem por limite por ativo (LVI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.18	Envia ordem de venda (1º Ativo) 500@24	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.19	Modifica ordem de venda (O.16) 1500@24	Mensagem de rejeição de modificação de ordem por limite por boleta (TVI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.20	Modifica ordem de venda (O.14) 1000@24	Mensagem de rejeição de modificação de ordem por limite por ativo (LVI)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.21	Cancela ordem de venda (O.18) 500@24	Mensagem de cancelamento de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.22	Envia ordem de venda (2º Ativo) 1000@30	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.23	Envia ordem de venda (2º Ativo) 600@30	Mensagem de rejeição de registro de ordem por instrumento equivalente (LVC)	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.24	Envia ordem de venda (2º Ativo) 100@30	Mensagem de registro de ordem	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
O.25	Cancela todas as ordens de venda para 1º e 2º Ativos	Mensagens de cancelamento de ordens	C	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

P. Self Trade Prevention Grupo de repetição adicional: 452=5 Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
P.1	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 12345678901 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 12345678901 	Oferta de compra é aceita Oferta de venda é aceita e na sequência é eliminada (tag 378=103)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.2	Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 Investor ID: 12345678901 	Registro da ordem	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.3	Cliente: Enviar modificação da ordem de venda pendente <ul style="list-style-type: none"> De: 100@21,00 Alterar para: 100@20,00 	Oferta de venda é modificada e na sequência é eliminada (tag 378=103)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.4	CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 98765432109 	Negócio gerado	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.5	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 98765432109 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 12345678901 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 300@20,00 Investor ID: 12345678901 CTC: Cancela a ordem remanecente.	Negocio Parcial é gerado e o restante da ordem é eliminado na sequência (tag 378=103)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.6	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 98765432109 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, FOK <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 12345678901 	Negocio gerado	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.7	CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 98765432109 Cliente: Enviar ordem de venda limitada, FOK <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Investor ID: 12345678901 	Oferta de venda é aceita e na sequência é eliminada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.8	Cliente: Enviar ordem de venda limitada, FOK <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 98765432109 	Oferta de venda é aceita e na sequência é eliminada (tag 378=103)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.9	Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 12345678901 	Negocio gerado	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.10	Cliente: Enviar ordem de compra stop limit, DIA <ul style="list-style-type: none"> 200@22,00 Preço stop: 21,00 Investor ID: 98765432109 CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA	Oferta de venda é aceita depois disparada e na sequência é eliminada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

	<ul style="list-style-type: none"> 200@21,00 Investor ID: 98765432109 <p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@21,00 Investor ID: 12345678901 				
P.11	<p>Cliente: Enviar ordem de compra a mercado limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado Investor ID: 12345678901 	Negocio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.12	CTC: Cancelar a(s) ordem(ns) em aberto	Cancelamento das ordens	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.13	<p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 98765432109 <p>Cliente: Enviar ordem de venda a mercado, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 200@Mercado Investor ID: 98765432109 	Oferta de venda é aceita e na sequência é eliminada (tag 378=103)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.14	<p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, IOC/FAK</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Investor ID: 12345678909 <p>CTC: Envia o cancelamento da ordem pendente</p>	Negocio gerado.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
P.15	<p>CTC: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 Investor ID: 98765432109 <p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, IOC/FAK</p> <ul style="list-style-type: none"> 200@20,00 Investor ID: 98765432101 	Oferta de venda é aceita e na sequência é eliminada (tag 378=103)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

Q. Operações de Mercado - Trade on Behalf
Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos
Modelos de acesso: MESA

Para executar esse cenário você vai precisar:

Duas sessões (SenderCompID): A e B, que serão usadas para os papéis de supervisor e de operador

Dois Entering Traders, Um configurado como Operador simples (OPE), e outro configurado como supervisor (SUP) – Contate o CTC para essas informações.

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
Q.1	Cliente: Envia ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • SenderCompID: A • Entering Trader: OPE • Sender Location: BVMF 	Ordem é aceita	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
	Cliente: Modifica a compra enviada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • SenderCompID: B • Entering Trader: OPE • Executing trader: SUP • Sender Location: BVMF 	Ordem é modificada			
Q.2	Cliente: Envia ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • SenderCompID: B • Entering Trader: OPE • Executing trader: SUP • Sender Location: BVMF 	Ordem é aceita	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
	Cliente: Modifica a compra enviada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • SenderCompID: A • Entering Trader: OPE • Sender Location: BVMF 	Ordem é modificada			
Q.3	Cliente: Envia ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • SenderCompID: B • Entering Trader: OPE • Executing trader: SUP • Sender Location: DMA1 	Ordem Rejeitada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Q.4	Cliente: Envia ordem de compra limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • SenderCompID: A • Entering Trader: OPE • Sender Location: DMA1 	Ordem é aceita	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
	Cliente: Modifica a compra enviada, DIA <ul style="list-style-type: none"> • SenderCompID: B • Entering Trader: OPE • Executing trader: SUP • Sender Location: BVMF 	Modificação Rejeitada			

R1. Termo Tag 35=R Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
CTC: Enviar uma ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@20,00					
R1.1	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21 CTC: Recebe declaração e a aceita	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R1.2	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) (35=R) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21 CTC: Recebe declaração e a rejeita	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é rejeitado. Recebe Quote Request Reject (35=AG)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R1.3	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) (35=R) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21 CTC: cancela declaração de termo	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é cancelado. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297=17 e a tag 35005=2 (Cancel)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R1.4	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) (35=R) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 12345TAG 5706 (FixedRate): 0.21	Termo é rejeitado, recebe Quote Request Reject (35=AG)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R1.5	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) (35=R) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21 Cliente: Enviar cancelamento do termo (35=Z)	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é cancelado. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a TAG 297=17 e a tag 35005=2 (Cancel)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R1.6	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) (35=R) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21 Cliente: Enviar cancelamento do termo (35=Z) com a tag 117 (QuoteID) = valor inválido	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo NÃO é cancelado. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297=9 (Quote Not Found) e 35005 = 3 (reject)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R1.7	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) (35=R) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21 CTC: Recebe declaração e a aceita CTC: Enviar o cancelamento da execução do termo	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F. Recebe 2 execution reports com a TAG 150=H	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

R1.8	<p>Cliente: Enviar declaração de termo (35=R), em modo Cross</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 TAG 5706 (FixedRate): 0.21 	<p>Recebe 2 Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New)</p> <p>Recebe 4 execution reports, com a TAG 150=F.</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R1.9	<p>Cliente: Enviar declaração de termo (compra) (35=R) como DMA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 TAG 5706 (FixedRate): 0.21 SenderLocation: DMA <p>CTC: Recebe declaração e a aceita</p>	<p>Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New)</p> <p>Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F.</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

R2. Termo Cash					
Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: DMA e Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
CTC: Enviar uma ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none">100@20,00					
R2.1	Cliente: Enviar declaração de termo vista (compra) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1 CTC: Recebe declaração e a aceita	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R2.2	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1 CTC: Recebe declaração e a rejeita	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é rejeitado. Recebe Quote Request Reject (35=AG)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R2.3	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1 CTC: cancela declaração de termo	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é cancelado. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297=17 e a tag 35005=2 (Cancel)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R2.4	Cliente: Enviar declaração de termo vista (compra) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1 CTC: Recebe declaração e a aceita CTC: Enviar o cancelamento da execução do termo	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F. Recebe 2 execution reports com a TAG 150=H	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R2.5	Cliente: Enviar declaração de termo vista (compra) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1 Cliente: Envia o cancelamento da declaração do termo (35=Z)	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é cancelado. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a TAG 297=17 e a tag 35005=2 (Cancel)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R2.6	Cliente: Enviar declaração de termo vista (venda) <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 12345TAG 5706 (FixedRate): 0.21TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1	Termo é rejeitado. Recebe Quote Request Reject (35=AG)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
R2.7	Cliente: Enviar declaração de termo (compra) como DMA <ul style="list-style-type: none">100@20,00TAG 5497 (DaysToSettlement): 50TAG 5706 (FixedRate): 0.21TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1SenderLocation: DMA	Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New) Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

	CTC: Recebe declaração e a aceita	execution reports, com a tag 150=F.			
R2.8	CTC: Cancela a ordem de venda limitada Cliente: Enviar declaração de termo vista (compra) <ul style="list-style-type: none"> • 100@20,50 • TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 • TAG 5706 (FixedRate): 0.21 • TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 1 	Termo é rejeitado. Recebe Quote Request Reject (35=AG)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

R3. Termo Vista Registrado Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: DMA e Mesa				
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status
CTC: Fechar negócios e passar o número para o cliente, durante a execução deste cenário. CTC: Enviar uma ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 				
R3.1	<p>Cliente: Enviar declaração de termo vista (compra)</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 TAG 5706 (FixedRate): 0.21 TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 0 TAG 6032 (Unique TradeID): número do negócio <p>CTC: Recebe declaração e a aceita</p>	<p>Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New)</p> <p>Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F.</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
R3.2	<p>Cliente: Enviar declaração de termo (compra)</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 TAG 5706 (FixedRate): 0.21 TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 0 TAG 6032 (Unique TradeID): número do negócio recebido pelo cliente <p>CTC: Recebe declaração e a rejeita</p>	<p>Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New)</p> <p>Termo é rejeitado. Recebe Quote Request Reject (35=AG)</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
R3.3	<p>Cliente: Enviar declaração de termo (compra)</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 TAG 5706 (FixedRate): 0.21 TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 0 TAG 6032 (Unique TradeID): número do negócio <p>CTC: cancela declaração de termo</p>	<p>Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New)</p> <p>Termo é cancelado. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297=17 e a tag 35005=2 (Cancel)</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
R3.4	<p>Cliente: Enviar declaração de termo vista registrado (compra)</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 TAG 5706 (FixedRate): 0.21 TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 0 TAG 6032 (Unique TradeID): número do negócio <p>CTC: Recebe declaração e a aceita</p> <p>CTC: Enviar o cancelamento da execução do termo</p>	<p>Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New)</p> <p>Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F.</p> <p>Recebe 2 execution reports com a TAG 150=H</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E
R3.5	<p>Cliente: Enviar declaração de termo (compra) como DMA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 TAG 5497 (DaysToSettlement): 50 TAG 5706 (FixedRate): 0.21 TAG 35004 (ExecuteUnderlyingTrade): 0 TAG 6032 (Unique TradeID): número do negócio recebido pelo cliente SenderLocation: DMA <p>CTC: Recebe declaração e a aceita</p>	<p>Termo fica pendente. Recebe Quote Status Report (35=AI) com a tag 297 (QuoteStatus) = 10 (Pending) e a tag 35005=0 (New)</p> <p>Termo é aceito. Recebe Quote (35=S) e 2 execution reports, com a tag 150=F.</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass <input type="checkbox"/> N/E

S1. Exercício e Bloqueio

Disponível em: PUMA Equities;
Modelos de acesso: Mesa

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
S1.1	<p>Cliente: Enviar exercício de opção:</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade: 100 TAG 35=AL Lançador: conta A Titular: conta B 	Recebe 35=AM com a TAG 722=3 (Completed)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S1.2	<p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA, na opção correspondente ao exercício acima</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: qualquer um que não A <p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA, na opção correspondente ao exercício acima</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: conta A 	<p>Recebe Execution Report com a tag 150=F</p> <p>CTC Recebe 35=AM com a tag 709=101 (Auto blocking of short option position)</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S1.3	<p><i>Bloqueio manual</i></p> <p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA,</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: conta diferente do lançador e titular <p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA, na opção correspondente ao exercício acima</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: conta diferente do lançador e titular e da conta acima <p>Cliente: Enviar 35=J (EB allocation instruction)</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade:100 Cliente: conta A (lançador) Número do negócio gerado acima 	<p>Negócio gerado</p> <p>Recebe EB allocation report (35=AS) com a tag 87=0 (Accepted successfully processed)</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S1.4	<p><i>Cancelar bloqueio através do cancelamento de trade</i></p> <p>CTC: Cancelar o negócio gerado no passo R1.3</p>	<p>Recebe o cancelamento do negócio</p> <p>Recebe o Allocation Report (35=AS)</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S1.5	<p><i>Cancelar bloqueio através do cancelamento via Bolsa</i></p> <p>Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA,</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: conta diferente do lançador e titular <p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA, na opção correspondente ao exercício acima</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 Cliente: conta diferente do lançador e titular e da conta acima <p>Cliente: Enviar 35=J (EB allocation instruction)</p> <ul style="list-style-type: none"> Quantidade:100 Cliente: conta A (lançador) Número do negócio gerado acima <p>CTC: Cancelar o bloqueio</p>	<p>Negócio gerado</p> <p>Recebe EB allocation report (35=AS) com a tag 87=0 (Accepted successfully processed)</p> <p>Recebe o cancelamento do bloqueio (35=AM com a tag 712=3)</p>	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

S2. Registro de Exercício Automático Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: DMA e Desk Trader					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
S2.1	<i>Aguardar CTC configurar o intervalo para o envio de novos registros</i> Cliente: Enviar registro de exercício de opção: Participante envia mensagem Tags:35=AL 709=102; 712=1 e 35048= 0.10	Recebe 35=AM com a TAG 722=0	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S2.2	Cliente: Enviar novo registro de exercício de opção: Participante envia mensagem Tags:35=AL 709=102; 712=1 e 35048= 0.10	Recebe 35=AM com a TAG 722=0			
S2.3	Cliente: Solicita o cancelamento do registro anterior (passo S2.2)	Registro Cancelado Recebe 35=AM com a tag 722=0	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S2.4	Cliente: Enviar novo registro exercício de opção fora do preço de referência e do LTP	Recebe 35=AM com a TAG 722=0	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S2.5	<i>Encerramento do Período para Envio de Registro</i> Cliente: Enviar novo registro exercício de opção	Registro Rejeitado	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
S2.6	Cliente recebe Execution referente ao passo S2.1 e o Cancelamento do registro enviado no passo S2.3	35=8 Execution Report do registro do passo S2.1 35=AM Cancelamento	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

T. Cancelamento em Desconexão Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: DMA					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
T.1	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=0 e 35003=0	Sessão FIX conectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.2	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTC • 100@21,00 Cliente: Enviar ordem de compra limitada, GTD • 100@22,00	Registro de ordens Ordens no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.3	Cliente: Desconectar a aplicação via Gerenciador de Tarefas ou desconectar o cabo de rede	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.4	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=0 e 35003=0 Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)	Sessão FIX reconectada As ordens ainda persistem no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.5	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.6	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=0 e 35003=0 Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)	Sessão FIX reconectada As ordens ainda persistem no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.7	Cliente: Desconectar a sessão FIX	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.8	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=1 e 35003=30000	Sessão FIX conectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.9	Cliente: Desconectar a aplicação via Gerenciador de Tarefas ou desconectar o cabo de rede	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período menor do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.10	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=1 e 35003=30000 Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)	Sessão FIX reconectada As ordens ainda persistem no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.11	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período maior do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.12	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=1 e 35003=30000 Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)	Sessão FIX reconectada As ordens ainda persistem no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

T.13	Cliente: Desconectar a aplicação via Gerenciador de Tarefas ou desconectar o cabo de rede	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período maior do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.14	<p>Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=1 e 35003=30000</p> <p>Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)</p>	<p>Sessão FIX reconectada</p> <p>CLIENTE recebe mensagens de cancelamento da ordem LIMITADA DIA e confirma o recebimento do Execution Report 35=8 e TAG 150=4</p> <p>As ordens ainda persistem no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 (GTD) 100@21,00 (GTC) 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.15	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.16	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=2 e 35003=30000	Sessão FIX conectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.17	<p>Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	<p>Ordens no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 (GTD) 100@21,00 (GTC) 100@20,00 (DIA) 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.18	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período menor do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.19	<p>Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=2 e 35003=30000</p> <p>Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)</p>	<p>Sessão FIX reconectada</p> <p>As ordens ainda persistem no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 (GTD) 100@21,00 (GTC) 100@20,00 (DIA) 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.20	Cliente: Desconectar a aplicação via Gerenciador de Tarefas ou desconectar o cabo de rede	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período maior do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.21	<p>Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=2 e 35003=30000</p> <p>Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)</p>	<p>Sessão FIX reconectada</p> <p>As ordens ainda persistem no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 (GTD) 100@21,00 (GTC) 100@20,00 (DIA) 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.22	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período maior do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.23	<p>Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=2 e 35003=30000</p> <p>Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)</p>	<p>CLIENTE recebe mensagens de cancelamento da ordem LIMITADA DIA e confirma o recebimento do Execution Reports 35=8 e TAG 150=4</p> <p>As ordens ainda persistem no book:</p> <ul style="list-style-type: none"> 100@22,00 (GTD) 100@21,00 (GTC) 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.24	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

T.25	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=3 e 35003=30000	Sessão FIX conectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.26	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00	Registro de ordens Ordens no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.27	Cliente: Desconectar a aplicação via Gerenciador de Tarefas ou desconectar o cabo de rede	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período menor do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.28	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=3 e 35003=30000 Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)	Sessão FIX reconectada As ordens ainda persistem no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.29	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período maior do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.30	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=3 e 35003=30000 Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)	Sessão FIX reconectada CLIENTE recebe mensagens de cancelamento da ordem LIMITADA DIA e confirma o recebimento do execution reports 35=8 e TAG 150=4 As ordens ainda persistem no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.31	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA • 100@20,00	Registro de ordens Ordens no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC) • 100@20,00 (DIA)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
T.32	Cliente: Enviar mensagem de logout	Sessão FIX desconectada	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
Aguardar período maior do que o tempo configurado no acionamento de COD					
T.33	Cliente: Enviar mensagem de logon com as TAGs 35002=3 e 35003=30000 Cliente: Enviar uma mensagem de resend request (35=2)	CLIENTE recebe mensagens de cancelamento da ordem LIMITADA DIA e confirma o recebimento do execution reports 35=8 e TAG 150=4 As ordens ainda persistem no book: • 100@22,00 (GTD) • 100@21,00 (GTC)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

U. Criação e Negociação de Estratégias Tag 35=c Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: Mesa					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
U.1	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com DUAS patas para o mesmo papel (ex: C1 VALE3 + V1 VALE3)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=5 (Rejected)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.2	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com DUAS patas para papéis diferentes Vista/Vista (ex: C1 VALE3 + V1 VALE5)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.3	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com DUAS patas para papéis diferentes Vista/Opção (ex: C1 PETR4 + V1 PETRF74)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.4	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com DUAS patas para papéis diferentes Opção/Opção (ex: C1 PETRF25 + V1 PETRF28)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.5	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com TRÊS patas para papéis diferentes Vista/Vista/Vista (ex: C1 USIM3 + V1 USIM5 + C1 USIM6)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.6	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com TRÊS patas para papéis diferentes Opção/Opção/Opção (ex: C1 UGPAA20 + V2 UGPAA22 + C1 UGPAA26)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.7	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com QUATRO patas para papéis diferentes Vista/Vista/Vista/Vista (ex: C1 VALE3 + V1 VALE5 + C1 VIVT3 x V1 VIVT5)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.8	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com QUATRO patas para papéis diferentes Opção/Opção/Opção/Opção (ex: C1 PETRF30 + V1 PETRR30 + C1 PETRR31 x V1 PETRF31)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.9	Cliente: Enviar Solicitação de Criação de Instrumento com CINCO patas para papéis diferentes Vista/Opção/Opção/Opção/Opção (ex: C1 PETR4 + C1 PETRF14 + C1 PETRF15 + C1 PETRF16 x C1 PETRF17)	CLIENTE recebe mensagem Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.10	Cliente: envia uma requisição para criação de estratégia 3W (tag 35=c): <ul style="list-style-type: none"> • Compra 1 Call at strike2exp1 (inst 1) • Vende 1 Call at strike3exp1 (inst 2) • Vende 1 Put at strike1exp1 (inst 3) OBS: Passo Executado apenas em New Release	Cliente recebe uma mensagem de Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.11	Cliente: envia uma requisição para criação de estratégia 3C (tag 35=c): <ul style="list-style-type: none"> • Compra 1 call at strike1exp1 (inst 1) • Compra 1 Put at strike1exp1 (inst 2) • Venda 1 Call at strike2exp1 (inst 3) OBS: Passo Executado apenas em New Release	Cliente recebe uma mensagem de Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.12	Cliente: envia uma requisição para criação de estratégia GN (tag 35=c): <ul style="list-style-type: none"> • Compra 1 instrument 1 • Compra 1 instrument 2 • Compra 1 instrument 3 • Venda 1 instrument 4 • Venda 1 instrument 5 • Venda 1 instrument 6 OBS: Passo Executado apenas em New Release	Cliente recebe uma mensagem de Security Definition 35=d com a TAG 323=1 (Accepted)	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
CTC altera o estado da UDS para Suspenso, reserva o instrumento e autoriza a entrada de ordens					
U.13	Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA em um UDS criado	Nova ordem no book para a estratégia criada.	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

	<ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 				
U.14	CTC: Enviar ordem de venda limitada, DIA <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	Nova ordem Venda no book: <ul style="list-style-type: none"> 100@20,00 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
U.15	CTC altera estado do instrumento para Aberto	CLIENTE recebe Execution Reports: <ul style="list-style-type: none"> 1 Execution Report para a UDS 1 Execution Report para cada pata da UDS 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

V. Message Replay Disponível em: PUMA Equities; Modelos de acesso: Mesa e DMA					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
V.1	<p>Cliente: Logon</p> <p>Cliente: Envia 500 ordens compra limitada, DIA</p> <p>Cliente: Log out</p> <p>CTC: Cancela todas as ordens</p> <p>Cliente: Logon com tag 141=N Reset sequence reset desabilitada</p>	Recebe tag 35033=Y na mensagem de sequence reset	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
V.2	<p>Cliente: Conectar se a sessão de "Message Replay"</p> <ul style="list-style-type: none"> • Enviar a mensagem "Message Replay" request (35=BW) • ApplBegSeqNum = <número do sequencial de início de perda de mensagens informados no teste anterior>. • ApplEndSeqNum=<número do sequencial final de perda de mensagens informados no teste anterior>; 	<ul style="list-style-type: none"> • Recebe uma mensagem de recebimento da requisição (35=BX) • Recebe uma mensagem 35=BY indicando o início do processo de recuperação. • Recupera os Execution Reports perdidos(35=8) Com as seguintes tags adicionais: <ul style="list-style-type: none"> ◦ 1180: Original TargetCompld ◦ 1181: Original MsgSeqNum fo the message • Recebe uma mensagem 35=BY indicando o fim do recebimento das mensagens. 	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

W. Market Maker Protection					
Disponível em: PUMA Equities; Puma Derivativos					
Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
W.1	Aguardar CTC configurar Proteção para o grupo escolhido Cliente: Envia ordens Limitada DIA para os instrumentos do grupo CTC: executa as ordens até atingir ponto de proteção Cliente: envia ordens após atingir o ponto de proteção.	Ordens executadas Ordens restantes são canceladas Cliente recebe Execution Report para cada ordem cancelada com a tag: 378=200	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
W.2	Aguardar CTC alterar o estado do grupo para Pre-open e alterar novamente o Ponto de Proteção Cliente: Envia ordens Limitada DIA para os instrumentos do grupo até ultrapassar o ponto de proteção. Cliente: Enviar reinicialização do modo de proteção com a tag 9773=Y. Cliente envia nova ordem Limitada/DIA	Todas as ordens são aceitas enquanto o instrumento estiver no estado de pre-open Cliente recebe Execution Report de todas as ordens formadoras de preço teórico e as demais ordens canceladas com a tag: 378=200 Ordem é aceita	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
W.3	Aguardar CTC configurar Proteção para o grupo Escolhido NÃO permitindo que as ordens GTD e GTC sejam canceladas Cliente: Envia ordens Limitada DIA e ordens GTC/GTD para os instrumentos do grupo. Cliente envia ordens após atingir o ponto de proteção	As ordens Limitada DIA são canceladas e as ordens GTD/GTC permanecem no Book	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E
W.4	Aguardar CTC configurar Proteção para o grupo Escolhido NÃO permitindo que as ordens STOP sejam canceladas Cliente: Envia ordens Limitada DIA e ordens STOP para os instrumentos do grupo até atingir o limite de proteção	As ordens Limitada DIA são canceladas e as ordens STOP permanecem no Book	N	<input type="checkbox"/> Pass	<input type="checkbox"/> N/E

