

18 de maio de 2023
043/2023-VNC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Sessão de Negociação Simulada – PUMA Trading System**

Informamos que, em **27/05/2023** (sábado), será realizada sessão de negociação simulada para validar alterações a serem implementadas, dentre as quais destaca-se a atualização de componentes do PUMA Trading System, conforme previsto no Comunicado Externo 027/2023-VNC de 06/04/2023.

A participação de corretoras, vendedores e provedores independentes de software que atuam no Listado B3 **será obrigatória**.

Todas as ofertas e todos os negócios efetuados serão processados e difundidos por meio da plataforma de Market Data.

Os participantes acessarão o ambiente por meio das sessões de conectividade ou das telas de negociação que utilizam atualmente (ePUMA ou solução própria).

1. Validação em destaque para essa sessão de negociação simulada

- **Validação da produção paralela do Market Data binário – Feed A, Feed B e Feed C**

Informamos que durante a sessão simulada de negociação, a plataforma de Market Data Binário, denominada Binary UMDF, estará disponível para validação em ambiente de produção paralela, conforme Comunicado Externo 026/2023-VNC de 06/04/2023.

A produção paralela contemplará todos os canais do Market Data e os detalhes técnicos sobre o projeto podem ser encontrados em https://clientes.b3.com.br/pt_br/, Roadmap, digitando Market Data Binário no campo Filtro Avançado.

▪ **Negociação de grandes lotes**

Visando antecipar o planejamento dos participantes de mercado para o lançamento de novos produtos e funcionalidades para negociação de grandes lotes), informamos que, durante a sessão de negociação simulada, as soluções de blocos Midpoint, Request For Quote (RFQ) e Book of Block Trade (BBT) estarão disponíveis para teste conforme quadro abaixo.

Engine	Canal	Grupo BBT	Instrumento BBT	Grupo RFQ	Instrumento RFQ	Grupo MidPoint	Instrumento MidPoint
EQT01	MBO51	1W	GGBR4Q	1C	GGBR4R	1Q	GGBR4M

Informações e características técnicas do projeto de grandes blocos podem ser consultadas em <https://clientes.b3.com.br/>, Roadmap, Soluções de blocos B3.

▪ **LiNe Afinidade**

Em continuidade à evolução dos sistemas de risco de negociação e prezando pela eficiência de infraestrutura, informamos que todos os produtos estarão no modo afinidade, durante a sessão de negociação simulada, com exceção daqueles nas engines DRV04 (MarketsegmentID 74) e EQT04 (MarketsegmentID 86).

O cronograma de atualização pode ser consultado no site Clientes B3, em <https://clientes.b3.com.br/>, Roadmap, LiNe 5.0 – Afinidade por Núcleo de Negociação.

▪ Entrada de oferta – Novo campo para oferta direta

Como parte da preparação para o lançamento de novas funcionalidades e conforme Comunicado Externo 166/2022-VNC, informamos que, durante a sessão de negociação simulada, estará disponível na oferta direta (35=s) e seus respectivos Execution Report (35=8), nova tag opcional, 2523, denominada CrossedIndicator, onde poderão ser informados os respectivos domínios abaixo.

Domínio	Funcionalidade
1	Structured Transaction
2	Operational Error
3	TWAP/VWAP

Salientamos que a ePUMA também contará com a disponibilização desse novo campo (CrossedIndicator).

Entretanto, a nova tag numérica (35561) MinCrossQty, responsável por informar a quantidade mínima de contratos para ingresso de oferta direta dos ativos derivativos disponível para negociação no Market Data, conforme Comunicado Externo 166/2022-VNC, não será escopo dessa sessão simulada de negociação, sendo escopo de outra a ser divulgada oportunamente.

▪ Novos contratos de rolagens de pares de moedas

Informamos a disponibilização de novas operações estruturadas de rolagem de contrato futuro por dólar, com a mensagem de Execution Report para os contratos de rolagem e nos instrumentos que fazem parte de sua composição, conforme descrito no site de Clientes B3 em <https://clientes.b3.com.br/>, Roadmap, Rolagem de Futuros de Moedas Estrangeiro em USD.

- **EDS Fase II – Inclusão do Execution para IR1/WI1 e DR1/WDI1**

Informamos que, durante a sessão simulada de negociação, os contratos de rolagens de futuro de dólar e índice e seus respectivos minicontratos serão convertidos para os contratos no formato EDS.

Com essa melhoria, os clientes que negociarem esses contratos passarão a contar com a mensagem de Execution Report para os contratos de rolagem e nos instrumentos que fazem parte de sua composição. Nesse modelo, os participantes receberão o preço negociado da estrutura e de sua composição no momento da execução da operação.

Importante salientar que as características acima serão aplicadas somente durante a sessão de negociação simulada. No próximo dia útil **29/05/2023**, as características do contrato de rolagem retornarão para as características atualmente em produção.

A data efetiva sobre a mudança dessas características desses contratos no ambiente de produção será divulgada oportunamente, via Ofício Circular. Destacamos que essas características já estão disponíveis para validação no ambiente de certificação.

- **Market Data B3 – Atualização do Template FAST**

Em continuidade à evolução dos sistemas da negociação e prezando pela eficiência de infraestrutura, informamos que o template FAST será atualizado com a inclusão de um campo opcional do tipo Int64 (tag 35561), denominado MinCrossQty, conforme divulgado no Comunicado Externo 014/2023-VNC de 28/02/2023.

2. Horários da sessão de negociação simulada

Horário inicial	Horário final	Fase
10h00	11h00	Confirmação de presença e teste de conectividade
11h00	11h05	Pré-abertura
11h05	11h55	Negociação – roteiro obrigatório
11h55	12h30	Negociação livre

3. Escopo da sessão de negociação simulada

O escopo da sessão de negociação simulada abrangerá:

- teste de conectividade e envio de ofertas por meio de todas as soluções de negociação utilizadas diariamente em produção pelos participantes;
- recepção de dados do mercado (Market Data);
- negociação (envio de ordens e fechamento de negócios), conforme roteiro obrigatório;
- negociação simulada livre (envio de ordens e fechamento de negócios);
- cancelamento de ofertas via sessão supervisora;
- validação dos limites de negociação (LiNe 5.0), levando-se em consideração os limites vigentes ao fim da sessão de negociação do dia **26/05/2023** (sexta-feira);
- recepção de mensagens de execução geradas pelos sistemas de negociação;
- recepção de drop copy das mensagens de registro, modificação e cancelamento de ordens, bem como dos relatórios de execução;
- utilização de software de cancelamento de ofertas Firmsoft;
- recepção de notícias da negociação eletrônica;
- interação com a B3 para que atue como contraparte ou facilite a execução do cenário de simulação específico desejado pelo participante; e

- interação regular com a Superintendência de Suporte à Negociação pelos telefones (11) 2565-5021/5022 e e-mails suporteanegociacao@b3.com.br ou negociacao@b3.com.br.

O escopo da sessão de negociação simulada **não** abrangerá:

- utilização dos sistemas de pós-negociação, processamento da liquidação e dos sistemas de risco e de margem de garantia das câmaras de compensação e liquidação;
- produção e fornecimento de relatórios e arquivos da sessão de negociação simulada; e
- ofertas com validade ingressadas até **26/05/2023** (sexta-feira).

4. Interfaces a serem testadas na sessão de negociação simulada

- Interfaces de entrada de ordens e de cancelamento de ofertas certificadas para:
 - Protocolo EntryPoint; e
 - Sessão Supervisora.
- Interfaces de difusão de Market Data certificadas para:
 - Protocolo UMDF PUMA Conflated; e
 - Protocolo PUMA UMDF 2.0.
- Telas de negociação:
 - ePUMA; e
 - soluções próprias desenvolvidas por provedores independentes de tecnologia ou pelos participantes.

5. Teste matinal do sistema eletrônico de negociação

É **imprescindível** a participação de todas as corretoras no teste matinal, a ser executado no dia **29/05/2023** (segunda-feira), **das 7h às 7h45** para o **mercado de derivativos**; e **das 7h às 8h** para o **mercado de ações**, nos ambientes de produção.

Outras informações

As atividades que serão executadas durante o teste encontram-se no roteiro obrigatório. O Market Data dos instrumentos será enviado no decorrer da simulação.

A participação na sessão de negociação simulada deverá ser confirmada até as **12h do dia 25/05/2023** (quinta-feira), **exclusivamente** via e-mail suporteanegociacao@b3.com.br, com o assunto "Sessão de negociação simulada", contendo a identificação da instituição, a lista de nomes das pessoas que participarão e os respectivos telefones, bem como os e-mails para contato.

Mediante essa confirmação, o participante receberá o roteiro de testes, devendo preenchê-lo e enviá-lo para o e-mail mencionado acima.

Os participantes da sessão de negociação simulada deverão realizar os ajustes em seus sistemas internos, de modo que os resultados da simulação sejam devidamente segregados das sessões reais de negociação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Negociação Eletrônica pelos telefones (11) 2565-5021/5022.

Mario Palhares

Vice-Presidente de Operações – Negociação Eletrônica e CCP