



11 de julho de 2023
066/2023-VNC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

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

Informamos que, em **15/07/2023** (sábado), será realizada sessão de negociação simulada para validar alterações a serem implementadas, destacando-se a negociação de grandes lotes, a produção paralela do gateway binário, o LiNe Afinidade, o Market Data binário e a negociação de EDS, detalhados a seguir.

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. Validações em destaque para essa sessão de negociação simulada

- **Negociação de grandes lotes**

As soluções Midpoint, Request For Quote (RFQ) e Book of Block Trade (BBT), desenvolvidas para negociação de grandes lotes, 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.

▪ **Início da produção paralela do gateway binário**

Disponibilização do gateway binário (Binary EntryPoint) para validação do envio de ofertas para todos os instrumentos, em ambiente de produção, exceto para os instrumentos mapeados nos núcleos de negociação DRV05 (MarketsegmentID 76) e EQT04 (MarketsegmentID 86).

Ressaltamos que, após a sessão de negociação simulada, o envio de ofertas nos gateways binários será permitido apenas para os instrumentos de testes divulgados no Comunicado Externo 062/2023-VNC, de 29/06/2023.

Detalhes técnicos sobre o projeto podem ser encontrados em https://clientes.b3.com.br/pt_br/, Roadmap, digitando Gateway Binário no campo Filtro Avançado.

▪ **LiNe Afinidade**

Primeira onda, contemplando os núcleos DRV01 (MarketsegmentID 68) e EQT09 (MarketsegmentID 98), de correção do cenário de *in-flight modification*, identificado durante a implementação do projeto LiNe 5.0 – Afinidade por Núcleo de Negociação.

▪ **Market Data Binário**

Na versão do Market Data Binário que está em produção paralela, quando ocorre mudança de fase de grupo, é disparada uma mensagem de SecurityStatus com o campo 1174-SecurityTradingEvent igual a TRADING_SESSION_CHANGE. Na nova versão, o Snapshot Recovery Stream passará a enviar o campo 1174-SecurityTradingEvent no SecurityStatus igual a SBE_NULL, indicando que o estado do instrumento está seguindo a fase do grupo, conforme detalhado no documento Message Specification Guidelines.

Ajuste do campo “hiddenQty” na mensagem ExecutionSummary

Atualização do campo “hiddenQty”, enviado na mensagem ExecutionSummary_55, que passará a divulgar o mesmo valor do campo “fillQty” para as ofertas diretas (Cross). Essa mudança tem por objetivo evitar a interpretação incorreta da mensagem ExecutionSummary, uma vez que ofertas diretas não são envidas para o livro de ofertas.

Correção de comportamento na mensagem de SecurityStatus no Snapshot Recovery Stream

Na versão do Market Data Binário que está em produção paralela, excepcionalmente quando ocorre a primeira mudança de fase de grupo do dia (atualmente uma rápida transição de PAUSED para PRE-CLOSE/FORBIDDEN), é disparada uma mensagem de SecurityStatus com o campo 1174-SecurityTradingEvent preenchido, indevidamente, com o valor TRADING_SESSION_CHANGE. Na nova versão, o Snapshot Recovery Stream passará a enviar o campo 1174-SecurityTradingEvent no SecurityStatus igual a

066/2023-VNC

SBE_NULL, indicando que o estado do instrumento está seguindo a fase do grupo, conforme detalhado no documento Message Specification Guidelines.

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 ».

▪ **EDS de Rolagens de futuro de dólar, índices e seus respectivos minicontratos**

Disponibilização dos preços dos instrumentos que compõem as legs dos contratos de rolagens de Futuro de Dólar (DR1/WD1) e Futuro de Ibovespa (IR1/WI1), via Execution Report, conforme divulgado no Comunicado Externo 076/2023-VNC de 18/05/2023.

Detalhes técnicos sobre o projeto podem ser encontrados em https://clientes.b3.com.br/pt_br/, Roadmap, digitando EDS Fase II: Inclusão do Execution Report para (IR1/WI1) e (DR1/WD1).

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 **14/07/2023** (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 **14/07/2023** (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 **17/07/2023** (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 **18h do dia 13/07/2023** (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