

5 de julho de 2022
107/2022-VNC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **EntryPoint – Interface de Envio de Ordens: Atualização das Especificações Técnicas para Cancelamento de Ordens em Massa e Negociação de Blocos**

Informamos as atualizações das especificações técnicas e do Dicionário FIX da interface EntryPoint. As adequações fazem parte da preparação para o lançamento de produtos e funcionalidades.

1 – Funcionalidade de cancelamento de ordens em massa (*Mass Cancel*)

A funcionalidade *Mass Cancel* será uma evolução do *Session Level Cancel* e permitirá aos participantes de mercado realizarem o cancelamento em massa de todas as ofertas registradas no livro central, por meio da utilização de diferentes filtros, que poderão ser usados separadamente ou combinados.

a) Novos campos

Para viabilizar o uso de filtros para o cancelamento em massa, estarão disponíveis as seguintes novas TAGs, já existentes na especificação FIX:

- SecurityGroup (1151): será disponibilizada nas mensagens de OrderMassActionRequest (35=CA) e OrderMassActionReport (35=BZ). Pode

ser preenchida com o valor do grupo de negociação publicado no sinal de difusão de dados (Market Data) e permitirá o cancelamento de todas as ofertas de todos os instrumentos pertencentes a um determinado grupo de negociação;

- OrdTagID (35505): campo opcional que será disponibilizado nas mensagens OrderMassActionRequest (35=CA), OrderMassActionReport (35=BZ), NewOrderSingle (35=D), OrderCancelReplaceRequest (35=G) e Execution Report (35=8). Permitirá o cancelamento de todas as ofertas ativas no livro de ofertas identificadas por um valor preenchido pelo cliente no momento do registro;
- Symbol (55): campo opcional que será disponibilizado nas mensagens OrderMassActionRequest (35=CA) e OrderMassActionReport (35=BZ). Permitirá o cancelamento de todas as ofertas ativas em um único instrumento; e
- Side (54): campo opcional que será disponibilizado nas mensagens OrderMassActionRequest (35=CA) e OrderMassActionReport (35=BZ). Permitirá o cancelamento de todas as ofertas de compra ou todas as ofertas de venda.

b) Novos domínios

Para identificar que a solicitação de cancelamento em massa ocorreu devido a um erro operacional, a tag 378 (ExecRestatementReason), já existente na especificação do Execution Report (35=8), passará a abranger os domínios descritos a seguir:

Domínio	Descrição
207	Mass Cancel due to Operational Error Request
208	Mass Cancel due to Operational Error Effective

Adicionalmente, o domínio 207 (Mass Cancel due to Operational Error Request) poderá ser usado nas mensagens OrderMassActionRequest (35=CA) e OrderMassActionReport (35=BZ).

2 – Midpoint Order Book

Em preparação para o lançamento da funcionalidade Midpoint Order Book, como divulgado no Comunicado Externo 063/2022-VNC de 14/04/2022, serão disponibilizados novos domínios na mensageria FIX, conforme segue.

Para identificação dos cancelamentos automáticos, realizados pela B3, de ofertas do tipo Midpoint Order Book, a tag 378 (ExecRestatementReason) da mensagem Execution Report (35=8) passará a abranger o domínio 209 (Cancel on Midpoint Broker Only Removal).

Como forma de flexibilização dos modelos, novo domínio, denominado 4 (Broker Only Removal), será disponibilizado no campo Routing Instruction (35487), nas mensagens NewOrderSingle (35=D), OrderCancelReplaceRequest (35=G) e ExecutionReport (35=8).

107/2022-VNC

As especificações técnicas do EntryPoint, bem como o Dicionário FIX, estarão disponíveis em www.b3.com.br, Soluções, Plataformas, Puma Trading System, Desenvolvedores e vendedores, EntryPoint – Entrada de ofertas.

A data de implementação dos novos produtos nos ambientes de certificação e de produção, assim como demais aspectos técnicos, serão divulgados oportunamente.

A publicação das especificações técnicas EntryPoint, Dicionário FIX, ocorrerão no dia **08/07/2022**.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte à Negociação pelo telefone (11) 2565-5021 ou e-mail suporteanegociacao@b3.com.br.

Mario Palhares
Vice-Presidente de Operações – Negociação Eletrônica e CCP