

## ROTEIRO DE TESTES - TRADEMATE

### ROTEIRO DE TESTE CERTIFICAÇÃO PARA VALIDAÇÃO DO TRADEMATE

Este documento descreve os cenários de teste que as instituições participantes devem utilizar para validar o Trademate, a nova plataforma de negociação de renda fixa, no ambiente de certificação.

Os cenários foram definidos para serem executados de forma sequencial, permitindo ao participante simular situações semelhantes às de um dia de negociação.

### CONTATO

Trading Certification

- [tradingcertification@b3.com.br](mailto:tradingcertification@b3.com.br)
- 55 11 2565-5023

### 1. HISTÓRICO DE VERSÕES

Data	Versão	Descrição
22/05/2023	1.0	Criação do documento
24/05/2023	1.1	Ajustes de cenários
30/05/2023	1.2	Ajustes de requisitos de acesso e bandas de rejeição
13/07/2023	1.3	Inclusão de cenários: Mercado estruturado (Casadas) e Leilão
31/01/2024	1.4	Inclusão de ativo habilitado para testes: CBI0
24/07/2024	1.5	Inclusão de ativos habilitados para testes de crédito privado

### 2. REQUISITOS DE ACESSO

Os seguintes requisitos são necessários para acessar a plataforma:

- Microsoft .NET SDK 6.0
- Cliente Desktop da plataforma instalado na máquina do usuário responsável pelos testes

### 3. ACESSO

O acesso da nova plataforma será realizado utilizando as credenciais do usuário no Controle de Acesso Unificado da B3, o CAU (Login único para acessar todos os sistemas da B3).

Aqueles que já possuem acesso ao CAU, em certificação, deverão realizar o login e acessar o Trademate com as mesmas credenciais do CAU.

Para aqueles que não possuem acesso ao CAU, a B3 vai enviar as credenciais de certificação por e-mail para todos os usuários ativos do Trader.

Esse acesso será gerenciado posteriormente pelo usuário privilegiado da instituição no CAU.

## 5. ATIVOS AUTORIZADOS

### Tipos de oferta

Ativos autorizados para a fase de certificação:

- Títulos Públicos Federais
- CBIO
- Título de Crédito Privado

Oferta	Características
LIMITADA	Oferta com preenchimento de preço obrigatório.
MERCADO	Oferta agressora para comprar ou vender no melhor preço no book de ofertas.
C/ QUANTIDADE APARENTE	Oferta que possibilita a exibição de uma quantidade referente ao lote padrão* na tela de negociação, sendo sua quantidade total escondida.
INTERMEDIADA	Ordem por meio da qual o usuário (banco, gestora etc.) envia para interface por intermédio de uma corretora (com ou sem spread).
LIQUIDITY SEEKING	Nessa ordem o algoritmo de execução pode encontrar +1 de um top broker/meu broker a fim de "varrer" o livro e bater todas ordens de contrapartes diferentes

\*Observação: para mercados fracionários o multiplicador da quantidade aparente deve ser 10x o lote padrão

## 6. BANDAS E LIMITES PARA REALIZAÇÃO DO ROTEIRO OBRIGATÓRIO

As bandas que disparam leilão, rejeitam ofertas e de limite estático (permitem inserção de ordens durante o leilão) são definidas por ativo.

## **7. CONFIGURAÇÃO DO TOP BROKER**

Todos os Participantes devem selecionar ao menos um Top Broker para leilão para títulos públicos e privados. Para execução de alguns cenários sugere-se também a adoção de um TOP BROKER/MEU BROKER, principalmente quando não houver limite com a contraparte. Caso tenha realizado alterações de limite bilateral, elas estarão gravadas.

## **8. CONFIGURAÇÃO DO LIMITE DE HABILITAÇÃO E LIMITE DE CRÉDITO**

É possível editar a configuração dos limites de habilitação e de crédito (nominal).

## **9. CONFIGURAÇÃO DA CORRETAGEM**

É possível definir corretagens para diferentes classes de ativos na plataforma. Além disso, o participante pode optar por cobrar em valor monetário para crédito privado.

## **10. INSERÇÃO DE ORDENS**

Existem 3 formatos que podem ser utilizados para inserir as ordens no Book Público:

- Menu Negociação, Roteador de ordens: possibilita a inclusão de ordens intermediadas por um broker pré-selecionado ou um específico via combo box na tela
- Book Controlado (Order Book) com o ativo selecionado e via comando pré-configurado nas opções do usuário ou via menu Dados de Mercado, Cotações, nos ícones “+” e “-”
- Clonar ordens já enviadas via Menu Negociação, Monitor de Ordens

## 11. ROTEIRO PARA A MODALIDADE TELA

### 11.1 REALIZAÇÃO DE TESTES INDIVIDUAIS (Usuário Operador 1 – Instituição A)

Atividade	Resultado esperado
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, respeitando as bandas de preço.	Registro de ofertas nos livros
Modificar as ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, respeitando as bandas de preço.	Ofertas Modificadas
Cancelar as ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas Canceladas
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, utilizando a opção de quantidade aparente, e respeitando as bandas de preço.	Registro de ofertas nos livros
Modificar as ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, com a opção de quantidade aparente, sempre respeitando as bandas de preço.	Ofertas Modificadas
Cancelar as ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, com quantidade aparente, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas Canceladas
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, utilizando intermediador, e respeitando as bandas de preço.	Registro de ofertas nos livros
Modificar as ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, utilizando intermediador, sempre respeitando as bandas de preço.	Ofertas Modificadas
Cancelar as ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, com intermediador, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas Canceladas
Enviar ofertas de compra e venda no mercado Padrão e tipo Time in Force Liquidity Seeking	Registro de ofertas nos livros

Atividade	Resultado esperado
Modificar as ofertas de compra e venda no mercado Padrão e tipo Time in Force Liquidity Seeking	Ofertas Modificadas
Cancelar as ofertas de compra e venda no mercado Padrão e tipo Time in Force Liquidity Seeking	Ofertas Canceladas
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, NÃO respeitar as bandas de preço.	Ofertas Rejeitadas
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, utilizando a opção de quantidade aparente, e NÃO respeitar as bandas de preço.	Ofertas Rejeitadas
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, utilizando intermediador, e NÃO respeitar as bandas de preço.	Ofertas Rejeitadas
Enviar ofertas de compra e venda no mercado Padrão e tipo Time in Force Liquidity Seeking e NÃO respeitar as bandas de preço.	Ofertas Rejeitadas
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados para ativos com restrição.	Oferta Rejeitada
Ir em configurações, depois em Config e selecionar que aceita operar IF Restrito.	Registro de ofertas nos livros
Enviar ofertas de compra e venda no mercado fracionário para cotas de fundo fechada, com quantidade menos que 1.	Registro de ofertas nos livros

## 11.2 REALIZAÇÃO DE TESTES EM CONJUNTO (Usuário Supervisor 1, Usuário Supervisor 2 e Instituição A)

Atividade	Resultado esperado
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, respeitando as bandas de preço.	Registro de ofertas nos livros compartilhados.
Modificar as suas ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, respeitando as bandas de preço.	Ofertas Modificadas nos livros compartilhados.
Modificar as ofertas de compra e venda de outro operador da mesa nos mercados: Padrão e Fracionário, respeitando as bandas de preço.	Ofertas Modificadas nos livros compartilhados.
Cancelar as ofertas de compra e venda de outro operador da mesa nos mercados: Padrão e Fracionário, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas Canceladas nos livros compartilhados

## 12. ROTEIRO PARA A MODALIDADE MERCADO ESTRUTURADO (CASADAS)

### 12.1 REALIZAÇÃO DE TESTES INDIVIDUAIS (Usuário Operador 1 – Instituição A)

Atividade	Resultado esperado
Enviar ofertas de compra e venda no mercado Casadas.	Registro de ofertas nos livros
Modificar as ofertas de compra e venda no mercado Casadas.	Ofertas Modificadas
Cancelar as ofertas de compra e venda no mercado Casadas, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas Canceladas
Enviar ofertas de compra e venda no mercado Casadas, utilizando a opção de quantidade aparente.	Registro de ofertas nos livros
Modificar as ofertas de compra e venda no mercado Casadas.	Ofertas Modificadas
Cancelar as ofertas de compra e venda no mercado Casadas, com quantidade aparente, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas Canceladas

<p>Enviar ofertas de compra e venda no mercado Casadas, utilizando intermediador, e respeitando as bandas de preço.</p>	<p>Registro de ofertas nos livros</p>
<p>Modificar as ofertas de compra e venda no mercado Casadas, utilizando intermediador.</p>	<p>Ofertas Modificadas</p>
<p>Cancelar as ofertas de compra e venda no mercado Casadas, com intermediador, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.</p>	<p>Ofertas Canceladas</p>
<p>Enviar ofertas de compra e venda, de modo a fechar negócio no mercado Casadas, utilizando intermediador habilitado no sistema ePuma.</p>	<p>Registro de negócio no mercado Casadas e registro automático da operação futura no sistema ePuma</p>
<p>Abrir o Controle de Estratégia, apertar o botão Contas da Mesa e Adicionar Novo. Nessa tela cadastrar duas mesas de clientes. Além disso, o operador também poderá realizar o cadastro em massa via planilha de Excel, pelo botão Importar do Excel.</p>	<p>Mesas dos clientes cadastradas</p>
<p>Após o passo anterior, o operador deve enviar ofertas de compra e venda, de modo a fechar negócio no mercado Casadas. A operação aparecerá na tela do Controle de Estratégias, onde o operador selecionará as setas no canto superior direito (&lt;&lt;) e escolherá a Buyer Desk Account e a Seller Desk Account. Depois apertará o botão de enviar. Destacamos que o operador terá</p>	<p>Registro de ofertas nos livros e contas dos clientes selecionadas.</p>

### 13. ROTEIRO PARA A MODALIDADE VOICE Menu Negociação, Voice

Para criar um novo Voice, clicar no botão “Novo Voice Order”

Atividade	Resultado esperado	
	PBAL	GEST
Enviar um Voice nos mercados: Padrão e Fracionário para o mesmo participante, respeitando as bandas de preços e quantidade max e min, variando também a data de liquidação.	Registro de negócio	N/A
Enviar um Voice nos mercados: Padrão e Fracionário para outro participante, respeitando as bandas de preços e quantidade max e min, variando também a data de liquidação.	Negócio pendente de aprovação da contraparte	Negócio pendente de aprovação da contraparte
Rejeitar um Voice recebido de outra instituição, realizando a inclusão da justificativa.	Negócio rejeitado	Negócio rejeitado
Durante o preenchimento do Voice, alterar a taxa/preço e quantidade, realizando o cálculo de preço/taxa novamente.	Edição do negócio antes do envio	Edição no negócio antes do envio
Enviar um Voice nos mercados: Padrão e Fracionário e NÃO respeitar as bandas de preços e quantidades max e min.	Informações rejeitadas	Informações rejeitadas
Enviar um Voice para um cota de fundo fechado com quantidade menor que 1.	Registro de negócio	Registro de negócio
Enviar um Voice nos mercados: Padrão e Fracionário para outro participante. Após isso, clicar duas vezes no Voice pendente e solicitar a rejeição da operação antes do aceite da contraparte, selecionar a justificativa do cancelamento	Negócio rejeitado	Negócio rejeitado
Selecionar um Voice já aprovado pela contraparte, clicar no botão “Solicitar Cancelamento” e selecionar a justificativa.	Pendente Cancelamento Contraparte	Pendente Cancelamento Contraparte
Após a contraparte aceitar o cancelamento da operação, validar se aparece a mensagem “Pendente Cancelamento B3”	Pendente Cancelamento B3	Pendente Cancelamento B3
O time B3 irá cancelar a operação após solicitação de cancelamento de ambas partes. Averiguar o status da operação “Cancelada”.	Voice cancelado	Voice cancelado
Enviar um Voice para o mesmo participante (interno) e a operação será aprovada automaticamente. Após a aprovação da operação, clicar em “Solicitar Cancelamento” e escolher uma justificativa.	Pendente Cancelamento B3	Pendente Cancelamento B3
O time B3 irá cancelar a operação após solicitação de cancelamento de ambas partes. Averiguar o status da operação “Cancelada”.	Voice cancelado	Voice cancelado

Selecionar um Voice enviado anteriormente e clicar em “Clonar”. A boleta do Voice enviado abrirá e, após isso, trocar uma das informações da operação (ex: quantidade, taxa, PU, etc).	Voice clonado	Voice clonado
A equipe de certificação enviará uma massa de Voices para o participante. Após o recebimento das operações, o operador deverá clicar em “Ações em Lote”, onde abrirá um pop-up com as opções de aceitar, rejeitar e cancelar os voices selecionados. O Operador deverá realizar pelo menos uma das ações em lote.	Ações em Lote realizada	Ações em Lote realizada
Para o envio em lote dos Voices, o participante deverá clicar em “Upload de Voice”. Nessa tela ele deverá clicar em “Adicionar Linha” e preencher as informações necessárias para envio da operação. Após o preenchimento, o operador clicará em “Executar”.	Voice enviado	Voice enviado
Para a utilização da planilha: o participante clicará em “Baixar Template” e irá salvar em sua máquina o documento em Excel. Após isso, o modelo em Excel abrirá e o operador realizará o preenchimento da boleta. Por último, o participante irá clicar em “Upload Planilha” e selecionará o arquivo em questão e clicará em “Executar”.	Voice enviado	Vocie enviado
O time de Certificação da B3 enviará um voice para outro colega da mesma mesa do participante, que estará ausente. O operador deverá aceitar o Voice do colega	Voice aprovado	Voice aprovado
O time de Certificação da B3 enviará um voice para outro colega da mesma mesa do participante, que estará ausente. O operador deverá rejeitar o Voice do colega	Voice cancelado	Voice cancelado

#### 14. ROTEIRO PARA A MODALIDADE RFQ Menu Negociação, RFQ

Para criação de RFQs, utilizar botão “Novo RFQ”

Importante selecionar qual mesa/desk deve ser utilizada para criação/recepção de RFQs

Ponta	Atividade	Resultado esperado
Demandante	Criação de uma cotação de compra, venda e ambos, nos mercados: Padrão e Fracionário utilizando as opções "Minha Instituição estará visível" e "Aprovação ao meu critério", variando também a data de liquidação.	Criação de cotação
Demandante	Criação de uma cotação de compra, venda e ambos, nos mercados: Padrão e Fracionário, utilizando as opções "RFQ Anônimo" e "FIFO", variando também a data de liquidação.	Criação de cotação
Demandante	Criação de uma cotação de compra, venda e ambos, nos mercados: Padrão e Fracionário utilizando as opções "Minha Instituição estará visível" e "FIFO", variando também a data de liquidação.	Criação de cotação
Demandante	Criação de uma cotação de compra, venda e ambos, nos mercados: Padrão e Fracionário, utilizando as opções "RFQ Anônimo" e "Aprovação ao meu critério", variando também a data de liquidação.	Criação de cotação
Demandante	Criação de uma cotação de compra, venda e ambos e NÃO respeitar as bandas de preços e quantidade max e min.	Informações rejeitadas
Demandante	Criar cotação e selecionar no mínimo 3 instituições para participar da cotação.	Criação de cotação
Demandante	Criar cotação e selecionar todas as instituições para participar da cotação.	Criação de cotação
Demandante	Criar cotação e selecionar menos de 3 instituições para participar da cotação.	Informações rejeitadas
Demandante	Criar cotação e cancelar o RFQ após envio.	RFQ cancelado
Ofertante	Alterar a oferta enviada.	Alteração da ordem
Ofertante	Inserir mais de uma oferta na cotação.	Registro de oferta
Ofertante	Cancelar uma oferta.	Oferta cancelada

Ponta	Atividade	Resultado esperado
Demandante	Escolher apenas uma oferta selecionada no período de apuração da cotação.	Negócio fechados
Demandante	Escolher mais de uma oferta selecionada no período de apuração da cotação.	Negócios fechados
Demandante	Não escolher nenhuma das ofertas durante o período de apuração do RFQ.	RFQ expirado/sem negócios

## 15. ROTEIRO PARA LEILÃO

### 15.1 REALIZAÇÃO DE TESTES INDIVIDUAIS (Usuário Operador 1 – Instituição A)

Atividade	Resultado esperado
Enviar ofertas agressoras nos mercados: Padrão e Fracionário, respeitando as bandas de rejeição, mas ultrapassando as bandas de leilão.	Registro de ofertas nos livros e leilão iniciado
Melhorar as ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, enquanto o instrumento está em leilão, respeitando o limite estático, mas ultrapassando as bandas de rejeição.	Ofertas Modificadas dentro do leilão
Cancelar as ofertas de compra e venda participantes da formação do preço teórico nos mercados: Padrão e Fracionário, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas participantes do preço teórico não são canceladas.
Cancelar as ofertas de compra e venda que não estejam participando da formação do preço teórico nos mercados: Padrão e Fracionário, através das opções Cancelar e Cancelar Todas as Ofertas.	Ofertas não participantes do preço teórico são canceladas.
Enviar novas ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário enquanto o instrumento está em leilão, respeitando o limite estático, mas ultrapassando as bandas de rejeição.	Registro de ofertas nos livros dentro do leilão
Enviar ofertas de compra e venda nos mercados: Padrão e Fracionário, NÃO respeitar a banda de limite estático.	Ofertas Rejeitadas