

ROTEIRO DE CERTIFICAÇÃO FIX.SUITE

SUMÁRIO

1	PROCESSO DE AUTENTICAÇÃO	3
2	ROTEIRO PARA ROTEAMENTO DE ORDENS.....	3
	2.1 TIPOS DE ORDENS	3
	2.1.1 Roteamento de Ordem para o Módulo Oferta em Tela	3
	2.1.2 Roteamento de Ordem para o Módulo Bond Call	5
3	ROTEIRO PARA MÓDULO VOICE	7
	3.1 TIPOS DE VOICE.....	7
	3.1.1 Envio de Simple Voice	8
	3.1.2 Envio de Prime Broker Voice	9
	3.1.3 Envio de Funds Transfer Voice	10

1 PROCESSO DE AUTENTICAÇÃO

Neste ciclo de testes será validado o processo de autenticação do participante na sessão FIX.SUITE com o usuário de sessão FIX e com o usuário do Trader:

A – Processo de Autenticação				
Passo	Atividade	Resultado esperado	Status	
A1	Cliente: Efetuar o logon com o usuário da sessão FIX Tag: 35=A (Logon)	Login executado sem mensagem de erro. Tag: 35=A (Logon)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
A2	Cliente: Efetuar o login com o usuário do Trader utilizado pelo operador. Tag: 35=UCG (TraderLogin)	Login executado sem mensagem de erro. Tag: 35=UCI (TraderLoginResponse)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK

2 ROTEIRO PARA ROTEAMENTO DE ORDENS

2.1 TIPOS DE ORDENS

Ordem	Características
Roteamento de ordem para o Módulo Oferta em Tela	O roteamento de ordens utiliza a tag 35539=1 (BookIndication) para o direcionamento das ordens para o livro de ofertas.
Roteamento de ordem para o Módulo Bond Call	O roteamento de ordens utiliza a tag 35539=2 (BookIndication) para a direcionamento das ordens para o leilão eletrônico Bond Call.

2.1.1 Roteamento de Ordem para o Módulo Oferta em Tela

Neste ciclo de testes será validado o roteamento de ordem para o livro de ofertas, via FIX.SUITE:

B – Oferta em Tela			
Passo	Atividade	Resultado esperado	Status
Os cenários B1 e B2 são opcionais			

<p>B1</p>	<p>Trading Certification: Indicar a negociação de um instrumento que não esteja em um leilão Bond Call.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de <u>compra</u> via FIX sem a tag 35539=1 para o instrumento indicado.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=1 (BookIndication = Book) 54=1 (Side = Bid)</p>	<p>A ordem deve entrar no livro de ofertas.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>B2</p>	<p>Trading Certification: Indicar a negociação de um instrumento que não esteja em um leilão Bond Call.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de <u>venda</u> via FIX sem a tag 35539=1 para o instrumento indicado.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=1 (BookIndication = Book) 54=2 (Side = Offer)</p>	<p>A ordem deve entrar no livro de ofertas.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>Os cenários B3, B3.1, B4, B4.1, B4.2 e B4.3 devem ser executados para pelo menos um instrumento de cada segmento indicado no formulário de agendamento.</p>				
<p>B3</p>	<p>Trading Certification: Indicar a negociação de um instrumento que não esteja em um leilão Bond Call.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de <u>compra</u> via FIX com a tag 35539=1 para o instrumento indicado.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539= 1 (BookIndication = Book) 54=1 (Side = Bid)</p>	<p>A ordem deve entrar no livro de ofertas.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>B3.1</p>	<p>Trading Certification: Assumir o papel de contraparte e agredir a oferta enviada pelo participante em certificação.</p>	<p>O negócio deve ser gerado.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = Full Fill)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>B4</p>	<p>Trading Certification: Indicar a negociação de um instrumento que não esteja em um leilão Bond Call.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de <u>venda</u> via FIX com a tag 35539=1 para o instrumento indicado.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539= 1 (BookIndication = Book) 54=2 (Side = Offer)</p>	<p>A ordem deve entrar no livro de ofertas.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/>NOK</p>
<p>B4.1</p>	<p>Cliente: Enviar uma modificação via FIX do campo taxa ou PU, dependendo do papel negociado.</p> <p>Tag:</p>	<p>A ordem deve ser alterada no livro de ofertas.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=5 (OrdStatus = Replace)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>

	35=G(CancelReplace)	150=5 (ExecType = Replace)		
B4.2	<p>Cliente: Enviar uma modificação via FIX do campo quantidade.</p> <p>Tag: 35=G(CancelReplace)</p>	<p>A ordem deve ser alterada no livro de ofertas da Tela.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=5 (OrdStatus = Replace) 150=5 (ExecType = Replace)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
B4.3	<p>Cliente: Enviar um cancelamento via FIX.</p> <p>Tag: 35=F (OrderCancelRequest)</p>	<p>A ordem deve ser cancelada.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=4 (OrdStatus = Cancel) 150=4 (ExecType = Cancel)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
B5	<p>Trading Certification: Simular um leilão Bond Call para um instrumento.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de compra ou venda via FIX com a tag 35539=1 para o instrumento que está participando do leilão Bond Call.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=1 (BookIndication) 54=1 (Side = Bid)</p> <p>Ou 54=2 (Side = Offer)</p>	<p>A ordem deve ser rejeitada.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=8 (OrdStatus = Reject) 150=8 (ExecType = Reject)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
B6	<p>Trading Certification: O checkbox (FIX API OrderEntry Access) deverá ser desmarcado. E indicar a negociação de um instrumento que não esteja em um leilão Bond Call.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de compra ou venda via FIX com a tag 35539=1 para o instrumento indicado.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=1 (BookIndication = Book) 54=1 (Side = Bid)</p> <p>Ou 54=2 (Side = Offer)</p>	<p>A ordem não deve entrar no livro de ofertas.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=8 (OrdStatus = Reject) 150=8 (ExecType = Reject)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK

2.1.2 Roteamento de Ordem para o Módulo Bond Call

Neste ciclo de testes será validado o roteamento de ordem para o Leilão Eletrônico de Títulos Bond Call, via FIX.SUITE:

C – Bond Call			
Passo	Atividade	Resultado esperado	Status
Os cenários C1 e C2 são opcionais			

<p>C1</p>	<p>Trading Certification: Simular um leilão Bond Call para um instrumento.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de compra via FIX sem a tag 35539=2, para o instrumento que está participando do leilão Bond Call.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 54=1 (Side = Bid)</p>	<p>A ordem deve entrar no Bond Call.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>C2</p>	<p>Trading Certification: Simular um leilão Bond Call para um instrumento.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de venda via FIX sem a tag 35539=2, para o instrumento que está participando do leilão Bond Call.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 54=2 (Side = Offer)</p>	<p>A ordem deve entrar no Bond Call.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>C3</p>	<p>Trading Certification: Simular um leilão Bond Call para um instrumento.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de compra via FIX com a tag 35539=2 para o instrumento que está participando do leilão Bond Call.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=2 (BookIndication) 54=1 (Side = Bid)</p>	<p>A ordem deve entrar no Bond Call.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>C4</p>	<p>Trading Certification: Simular um leilão Bond Call para um instrumento.</p> <p>Cliente: Enviar uma ordem de venda via FIX com a tag 35539=2 para o instrumento que está participando do leilão Bond Call.</p> <p>Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=2 (BookIndication) 54=2 (Side = Offer)</p>	<p>A ordem deve entrar no Bond Call.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=0 (OrdStatus = New) 150=0 (ExecType = New)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>C4.1</p>	<p>Cliente: Enviar uma modificação via FIX do campo taxa para uma taxa pior, ou seja, uma taxa menos atrativa para o mercado.</p> <p>Tag: 35=G(CancelReplace)</p>	<p>Deve ser recebida mensagem de rejeição da modificação (“Error amending price on auction LE X cannot enter a worse price (Bond Call)”).</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=8 (OrdStatus = Reject) 150=8 (ExecType = Reject)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>
<p>C4.2</p>	<p>Cliente: Enviar uma modificação via FIX do campo taxa para uma taxa melhor, ou seja, uma taxa mais atrativa para o mercado.</p> <p>Tag: 35=G(CancelReplace)</p>	<p>A ordem deve ser alterada.</p> <p>Tags: 39=5 (OrdStatus = Replace) 150=5 (ExecType = Replace)</p>	<p><input type="checkbox"/>OK</p>	<p><input type="checkbox"/>NOK</p>

C4.3	Cliente: Aguardar o encerramento do leilão.	Leilão deve finalizar com os negócios concluídos.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
C5	Trading Certification: Indicar a negociação de um instrumento que não esteja em um leilão Bond Call. Cliente: Enviar uma ordem de compra via FIX com a tag 35539=2 para o instrumento que não está participando de um leilão Bond Call. Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=2 (BookIndication) 54=1 (Side = Bid) Ou 54=2 (Side = Offer)	A ordem deve ser rejeitada. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=8 (OrdStatus = Reject) 150=8 (ExecType = Reject)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
C6	Trading Certification: O checkbox (FIX API OrderEntry Access) deverá ser desmarcado. E indicar a negociação de um instrumento que não esteja em um leilão Bond Call. Cliente: Enviar uma ordem de compra via FIX com a tag 35539=1 para o instrumento indicado. Tags: 35=D (NewOrderSingle) 35539=1 (BookIndication = Book) 54=1 (Side = Bid) Ou 54=2 (Side = Offer)	A ordem deve ser rejeitada. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=8 (OrdStatus = Reject) 150=8 (ExecType = Reject)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK

3 ROTEIRO PARA MÓDULO VOICE

3.1 TIPOS DE VOICE

Voice	Características
Simple Voice	O Simple Voice utiliza a tag 828=0 (TrdType) para permitir ao participante lançar um Voice para confirmação de sua contraparte.
Prime Broker Voice	O Prime Broker Voice utiliza a tag 828=1 (TrdType) para permitir à corretora lançar um Voice para contrapartes que são seus clientes (intermediação).
Funds Transfer Voice	O Funds Transfer Voice utiliza a tag 828=3 (TrdType) para permitir ao gestor lançar um Voice de transferência de posições entre fundos desde que exista um intermediador padrão cadastrado no sistema.

3.1.1 Envio de Simple Voice

Neste ciclo de testes será validado o envio de Simple Voice, via FIX.SUITE:

B - Simple Voice				
Passo	Atividade	Resultado esperado	Status	
B1	<p>Cliente: Enviar um Simple Voice via FIX de venda para instituição indicada pelo Trading Certification.</p> <p>Trading certification: Assumir o papel de contraparte e aceitar o Voice enviado.</p> <p>Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=0 (TrdType = Regular Voice)</p>	<p>O negócio deve ser gerado.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = Full Fill)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
B2	<p>Cliente: Enviar 10 operações Simple Voice via FIX de compra ou venda para instituição indicada pelo Trading Certification.</p> <p>Trading certification: Assumir o papel de contraparte e aceitar os Voices enviados.</p> <p>Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=0 (TrdType = Regular Voice)</p>	<p>Os negócios devem ser gerados.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = Full Fill)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
B3	<p>Cliente: Enviar um Simple Voice via FIX de compra para instituição indicada pelo Trading Certification.</p> <p>Trading certification: Assumir o papel de contraparte e aceitar o Voice enviado.</p> <p>Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=0 (TrdType = Regular Voice)</p>	<p>O negócio deve ser gerado.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = FullFill)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
B4	<p>Cliente: Enviar um Simple Voice via FIX de compra para instituição indicada pelo Trading Certification.</p> <p>Trading certification: Aceitar a operação via Blotter na opção "Revisar".</p> <p>Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=0 (TrdType = Regular Voice)</p>	<p>O negócio deve ser gerado.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = FullFill)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
B5	<p>Cliente: Enviar um Simple Voice via FIX de compra para instituição indicada pelo Trading Certification.</p> <p>Trading certification: Assumir o papel de contraparte e rejeitar o Voice enviado.</p> <p>Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=0 (TrdType = Regular Voice)</p>	<p>O negócio não deve ser gerado.</p> <p>Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=8 (OrdStatus = Reject) 150=8 (ExecType = Reject)</p>	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK

3.1.2 Envio de Prime Broker Voice

Neste ciclo de testes será validado o envio de Prime Broker, via FIX.SUITE:

C – Prime Broker Voice				
Passo	Atividade	Resultado esperado	Status	
C1	Trading certification: Verificar se o participante está cadastrado como corretor principal e caso negativo habilitar esta opção.	Participante habilitado como corretora.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
C2	Cliente: Enviar um Prime Broker via FIX como corretora intermediadora com clientes distintos em ambas as pontas (compra e venda). Trading certification: Assumir o papel de parte e contraparte e aceitar os Voices enviados. Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=1 (TrdType = Prime Broker)	Os dois negócios devem ser gerados. E devem ser recebidos dois Executions Reports. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = FullFill)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
C3	Cliente: Enviar dez operações de Prime Broker via FIX como corretora intermediadora com clientes distintos em ambas as pontas (compra e venda). Trading certification: Assumir o papel de parte e contraparte e aceitar os Voices enviados. Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=1 (TrdType = Prime Broker)	Os vinte negócios devem ser gerados. E devem ser recebidos vinte Executions Reports por negócio. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = FullFill)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
C4	Cliente: Enviar um Prime Broker via FIX de compra para as instituições indicadas pelo Trading Certification. Trading certification: Aceitar a operação via Blotter na opção "Revisar". Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=1 (TrdType = Prime Broker)	O negócio deve ser gerado. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = FullFill)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
C5	Cliente: Enviar um Prime Broker via FIX de compra para instituição indicada pelo Trading Certification. Trading certification: Assumir o papel de contraparte e rejeitar o Voice enviado. Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=1 (TrdType = Prime Broker)	O negócio não deve ser gerado. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=8 (OrdStatus = Reject) 150=8 (ExecType = Reject)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK

3.1.3 Envio de Funds Transfer Voice

Neste ciclo de testes será validado o envio de Funds Transfer, via FIX.SUITE:

D - Funds Transfer Voice				
Passo	Atividade	Resultado esperado	Status	
D1	Trading certification: Habilitar o participante para passagem de fundos.	Participante habilitado para passagem de fundos.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
D1.1	Trading certification: Configurar o intermediador padrão para o participante.	Participante habilitado para passagem de fundos.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
D2	Cliente: Enviar um Fund Transfer via FIX com a própria instituição na compra e na venda. Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=3 (TrdType = Funds Transfer)	O negócio deve ser gerado. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = FullFill)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK
D3	Cliente: Enviar 10 operações de Fund Transfer via FIX com a própria instituição na compra e na venda. Tags: 35=s (NewOrderCross) 828=3 (TrdType = Funds Transfer)	Os negócios devem ser gerados. Tags: 35=8 (ExecutionReport) 39=2 (OrdStatus = Full Fill) 150=2 (ExecType = FullFill)	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> NOK