

05 de outubro de 2012
026/2012-DI

COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da BM&FBOVESPA (BVMF) – Segmento BOVESPA

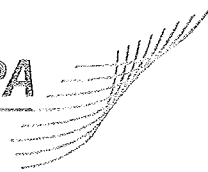
Ref.: Sessão de Negociação Simulada Obrigatória em 27/10/2012 – Mega Bolsa.

Em complemento ao Comunicado Externo 018/2012, de 10/08/2012, comunicamos que, em **27/10/2012** (sábado), será realizada negociação simulada para teste do sistema Mega Bolsa, sendo obrigatória a participação de corretoras, vendedores e provedores independentes de software que atuam no segmento BOVESPA, devido às atualizações a seguir.

- **Alteração do sinal de informações da BM&FBOVESPA no formato MMTP (Proxydiff), conforme Comunicado Externo 009/2012-DI, de 04/04/2012**
- MMTP (Proxydiff): Cabeçalho funcional (cap. 2.1 do manual) – Alteração do tipo de campo “Grupo de cotação”, de numérico para alfanumérico; e
- Mensagens S3-UpdatingOrderBook e S4-CancellationsInOrderBook (cap. 2.2.15 e 2.2.16 do manual) – Inclusão do campo OrderIdentificationExtended(17) ao final das mensagens.

Essas alterações estão detalhadas na versão 5.8 do Manual do Sinal de Informações disponível em www.bmfbovespa.com.br > Serviços > Serviços de Informação > Sinal de informações > Como Contratar (Pacotes) > Proxydiff.

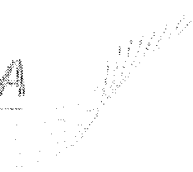




▪ **Movimentação de ativos entre grupos de cotações alfanuméricos no Mega Bolsa**

- Ativo que migra do grupo 18 para o grupo 1P: YPFL3. O fracionário migra para o grupo 2P; as séries de opções para o grupo 3P; e os ativos de exercícios de opções para o grupo 43.
- Ativos que migram do grupo 21 para o grupo 10: HRTP3, OGXP3, OSXB3, PETR3, PETR4 e RPMG3. Os fracionários migram para o grupo 11; as séries de opções, para o grupo 12; e os ativos de exercícios de opções para o grupo 43, exceto os ativos de exercícios de PETR3 e PETR4 que já se encontram no grupo 43.
- Ativos que migram do grupo 51 para o grupo 9A: BDRX, BDRX11, IBOV, IBOV11, IBRA, IBRA11, IBXL, IBXL11, IBXX, IBXX11, ICO2, ICO211, ICON, ICON11, IDIV, IDIV11, IEEX, IEEX11, IFIX, IFX11, IFNC, IFNC11, IGCT, IGCT11, IGCX, IGCX11, IGMN, IGMN11, IMAT, IMAT11, IMOB, IMOB11, INDX, INDX11, ISEE, ISEE11, ITAG, ITAG11, IVBX, IVBX11, MIBV, MIBV11, MLCX, MLCX11, SMLL, SMLL11, UTIL e UTIL11.
- Ativo que migra do grupo 51 para o grupo 1P: PREB11. O fracionário migra para o grupo 2P; as séries de opções para o grupo 3P; e os ativos de exercícios de opções para o grupo 43.
- Ativo que migra do grupo 54 para o grupo 10: QGEP3. O fracionário migra para o grupo 11; as séries de opções para o grupo 12; e os ativos de exercícios de opções para o grupo 43.
- Ativos que migram do grupo 68 para o grupo 27: GOLL3, IMBI3, IMBI4, LATM11, RCSL3 e RCSL4. Os fracionários migram para o grupo 28; as séries de opções para o grupo 29; e os ativos de exercícios de opções para o grupo 16.
- Ativos que migram do grupo 71 para o grupo 62: ALLL3, CCRO3, ECOR3, EMBR3, GOLL4, LLXL3, OHLB3, MRVE3, POMO4 e RAPT4. Os fracionários migram para o grupo 63; as séries de opções para o grupo 67; e os ativos de exercícios de opções para o grupo 16.





026/2012-DI

.3.

- Ativos que migram do grupo 74 para o grupo 77: JSIG3, LOGN3, POMO3, RAPT3 e TRPN3. Os fracionários migram para o grupo 78; as séries de opções para o grupo 79; e os ativos de exercícios de opções para o grupo 16; e
 - Ativos que migram do grupo 74 para o grupo 9A: BOVA, BOVA11, BRAX, BRAX11, CSMO, CSMO11, DIVO, DIVO11, ECOO, ECOO11, FIND, FIND11, GOVE, GOVE11, ISUS, ISUS11, MATB, MATB11, MILA, MILA11, MOBI, MOBI11, PIBB, PIBB11, SMAL, SMAL11, UTIP e UTIP11. Os fracionários migram para o grupo 9B; séries de opções para o grupo 9C; e os ativos de exercícios de opções dos ETFs, para o grupo 42.
- **Atualização do sinal de informações UMDF 1.6 (Mega Bolsa) conforme descrito no Anexo**

1. Horários da sessão de negociação simulada

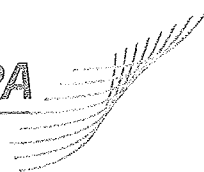
Horário inicial	Horário final	Fase
14:00	14:30	Confirmação de presença
14:30	15:00	Teste de conectividade
15:00	15:05	Pré-abertura
15:05	16:15	Negociação – roteiro obrigatório
16:15	16:55	Negociação livre
16:55	17:00	Call de fechamento

2. Escopo da sessão de negociação simulada

O escopo da sessão de negociação simulada abrangerá:

- Recepção de dados de mercado (market data);
- Negociação (envio de ordens e fechamento de negócios), conforme roteiro obrigatório;
- Negociação simulada livre (envio de ordens e fechamento de negócios);
- Validação dos limites de negociação, levando-se em conta os limites vigentes ao final de 26/10/2012;
- Recepção de mensagens de execução geradas pelos sistemas de negociação;
- Recepção de drop copy das mensagens de registro, modificação e cancelamento de ordens, e dos relatórios de execução;
- Utilização do software de cancelamento de ofertas eMEGA-X;
- Recepção de notícias da negociação eletrônica;





026/2012-DI

.4.

- Interação com a BM&FBOVESPA para que atue como contraparte ou facilite a execução do cenário de simulação específico desejado pelo participante; e

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

- Recepção do sinal STM contendo os negócios realizados;
- Utilização dos sistemas de pós-negociação, processamento da liquidação e dos sistemas de risco e de margem de garantia das clearings;
- Utilização do sistema Sinacor;
- Produção e fornecimento de relatórios e arquivos da sessão de negociação simulada.

3. Interfaces a serem testadas na sessão de negociação simulada

Poderão ser testadas as seguintes interfaces:

- Interfaces de entrada de ordens certificadas para:
 - Protocolo Mega Direct; e
 - Protocolo EntryPoint.
- Interfaces de difusão de market data certificadas para:
 - Protocolo Proxydiff; e
 - Protocolo UMDf-MegaBolsa (FIX 5.0 FAST).

Será obrigatório o teste das soluções de tela de negociação utilizada pelas mesas de operações das corretoras, seja esta fornecida pela Bolsa (Estação Mega Bolsa), por provedores independentes de tecnologia ou desenvolvida pelos participantes.

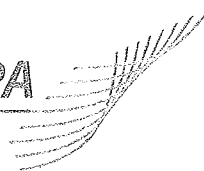
4. Teste matinal do sistema eletrônico de negociação

Como a sessão simulada será realizada em ambiente de produção, é **imprescindível** a participação de todas as corretoras no teste matinal, a ser executado em **29/10/2012** (segunda-feira), a partir das 7h.

5. Outras informações

Os instrumentos a serem utilizados durante a sessão de negociação simulada, bem como as atividades a serem executadas durante o teste, encontram-se no roteiro obrigatório. O market data desses instrumentos será enviado no decorrer da simulação.

A participação na sessão de negociação simulada deverá ser confirmada até as **18h de 26/10/2012**, por e-mail, para suporteanegociacao@bvmf.com.br ou



026/2012-DI


.5.

tradingsupport@bvmf.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 e e-mails para contato. Mediante essa confirmação, o participante receberá o roteiro de teste obrigatório.

Ressaltamos que 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 Gerência de Suporte à Negociação (GSN), pelo telefone (11) 2565-5000, opção 2, ou com a Gerência de Negociação de Renda Variável, pelos telefones (11) 2565-4304/4305.

Atenciosamente,


Luis Otávio Saliba Furtado
Diretor Executivo de Tecnologia e Segurança da Informação

Anexo ao Comunicado Externo 026/2012-DI

Atualizações na Versão 1.6 do UMDF

Atualizações gerais

G.1.6.1. Correção da falta de persistência de preço de fechamento (bloco 269=5) no Market Recovery (Snapshot). Agora o preço de fechamento do dia anterior (269=5, 286=4) deve estar persistido corretamente na reinicialização diária da plataforma.

G.1.6.2. Correção da publicação de horário de previsão de abertura (tag 342-TradSesOpenTime na mensagem SecurityStatus) nos casos de inexistência do campo “Horário de Abertura” na mensagem RLC-05 (Mudança de Estado do Papel) advinda do ProxyDiff.

G.1.6.3. Publicação de atualizações da especificação do papel na descrição do instrumento (tag 107-SecurityDesc) advindas da mensagem RLC-53 (Cadastro Básico do Papel).

G.1.6.4. Publicação da descrição do instrumento (tag 107-SecurityDesc) para índices (Canal 55).

G.1.6.5. Não publicação de status de Open na mensagem SecurityStatus (35=f) ao receber a mudança de fase na mensagem RLC-16 (Alteração do Estado do Grupo de Cotação) com o campo “Condição do Grupo de Cotação” para “O” (Opening), que é uma fase intermediária entre a pré-abertura e o estado aberto que não deve ser utilizada no esquema de fases e estados do UMDF.

G.1.6.6. Suporte ao campo “Identificação Estendida da Ordem” de 17 dígitos nas mensagens RLC S3 e S4 (advindas do PUMA).

G.1.6.7. Disseminação de instrumentos UDS vindos do PUMA com o código de negociação (tag 55-Symbol) correto (incluindo “UD:”), inclusive para casos onde se tem uma UDS de outras UDS.

G.1.6.8. Correção do tamanho da descrição do instrumento (tag 107-SecurityDesc) publicada na mensagem SecurityList (35=y), de 12 para 22 posições.

G.1.6.9. Mudança de comportamento da tag 83-RptSeq nas mensagens incrementais (35=X) e snapshot (35=W), retornando seu valor a 1 com a reinicialização diária da plataforma, o que impede o problema de continuidade do sequencial para instrumentos pouco líquidos (ex. termo), resolvendo o problema de clientes que usam a tag 83 para se recuperar.