



13 de outubro de 2011

002/2011-DI

COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da BM&FBOVESPA (BVMF) – Segmentos BM&F e BOVESPA – Vendors e Provedores de Softwares

Ref.: Atualização do UMDF para a Versão 1.5 – Disponibilização do Ambiente de Certificação e Cronograma de Atualização para Produção.

A BM&FBOVESPA notifica que está disponível no ambiente de certificação a versão 1.5 do UMDF e a disponibilizará no ambiente de produção a partir do dia **31/10/2011** para os mercados de ações e derivativos.

A especificação atualizada de mensagens do UMDF encontra-se disponível em <http://www.bmfbovespa.com.br/marketdata>, em “Como contratar (pacotes)” > UMDF Completo.

Informamos que essa versão requer atualização do arquivo de templates por parte do software-cliente que já pode ser encontrado para o ambiente de certificação no endereço:

<ftp://ftp.bmf.com.br/FIXFAST/templates/Certification/templates-UMDF.xml>

O arquivo de templates a ser usado em produção será disponibilizado em **28/10/2011** (sexta-feira anterior à atualização) após o fechamento do mercado no endereço:

<ftp://ftp.bmf.com.br/FIXFAST/templates/Production/templates-UMDF.xml>

Destacamos que a não atualização do arquivo de templates implicará a impossibilidade do software-cliente decodificar de maneira correta as informações publicadas pelo sistema UMDF. Reforçamos que é desejável que



002/2011-DI

.2.

sistemas cliente atualizem seus templates semanalmente aos domingos, como indicado na sessão 5.3.1 da especificação UMDF (documento *UMDF Functionality v1.5.1*).

Os detalhes da atualização da versão 1.5 do UMDF estão descritos no Anexo deste Comunicado. Soluções de *software* já certificadas não necessitam de recertificação; no entanto, é sugerido que clientes testem a nova versão no ambiente de certificação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Gerência de Desenvolvimento de Serviços, pelo e-mail marketdata@bvmf.com.br ou pelo telefone +55-11-2565-7105.

Atenciosamente,

Luis Otavio Saliba Furtado

Diretor Executivo de Tecnologia e Segurança da Informação

**Anexo ao Comunicado Externo 002/2011-DI****VERSÃO 1.5 DO UMDF****Atualizações gerais**

G.1.5.1. Mecanismo de recuperação utilizando o grupo de repetição “*EMPTY_BOOK*” sem identificação do instrumento foi adequadamente implementado. Após falha ou inicialização da sessão de negociação, os sistemas-cliente devem aguardar uma mensagem adicional contendo o “*EMPTY_BOOK*” (tag 269=J) sem o componente de identificação de instrumento (basicamente tag 48-*SecurityID*). Esta mensagem poderá incluir a informação de recomposição do livro de ofertas (grupos de repetição “*Bid*” ou “*Offer*” com o tag 276-*QuoteCondition* incluindo o valor ‘R’) para vários instrumentos com ordens abertas no momento da interrupção.

G.1.5.2. Consertado o defeito da mensagem de divulgação *SecurityStatus* (tag 35=f) sem o tag 207-*SecurityExchange* quando esta mensagem informa alteração na fase do grupo de negociação afetado.

G.1.5.3. Ajuste do problema que ocorre intermitentemente relacionado à não-inicialização do tag 83-*RptSeq* com valor “1” (um).

G.1.5.4. Ajuste do problema relacionado à concorrência simultânea entre uma “thread” de publicação e uma “thread” de “*heartbeat*” no serviço difusor, que estava afetando o seqüenciamento do TCP replay, principalmente no canal de índices e ETFs.

G.1.5.5. Ajuste do problema relacionado ao grupo de repetição cujo valor da tag 269-*MDEntryType* é igual a ‘c’ (fase e estado de negociação) em mensagens incrementais. Este grupo de repetição somente deve estar presente nas mensagens de “snapshot”. As atualizações em tempo real de fases e estados de negociação são difundidas por meio de mensagens *SecurityStatus* (tag 35=f).



**Atualizações relacionadas ao mercado de derivativos**

D.1.5.1. Reparado o defeito com o tag 207-*SecurityExchange* dos grupos de repetição *TradeVolume* (tag 269=B) e *OpenInterest* (tag 269=C) para o mercado de derivativos. Antes desta atualização, o valor era divulgado como “BVSP” em vez de “BVMF”;

D.1.5.2. Solucionado o problema com o tag 286-*OpenCloseSettlFlag* no grupo de repetição *SettlementPrice* (tag 269=6) que informa se o preço de ajuste relaciona-se ao dia atual ou ao dia útil anterior para mensagens de incremental e “snapshot”.

D.1.5.3. Solucionado o problema do tag faltante 731-*SettlPriceType* no grupo de repetição do *SettlementPrice* (tag 269=6) para mensagens incremental e “snapshot”.

Atualizações relacionadas ao mercado de ações

E.1.5.1. O tag 231-*ContractMultiplier* na mensagem *SecurityList* para o mercado de ações está obsoleto, mas ainda é válido. O novo tag 37012-*PriceDivisor* é o caminho para obter o fator de cotação.

E.1.5.2. Os tags 201-*PutOrCall* e 1194-*ExerciseStyle* foram acrescentados à mensagem *SecurityList*.

E.1.5.3. Os tags 623-*LegRatioQty* e 624-*LegSide* foram acrescentados à mensagem *SecurityList* de estratégias de ações.

E.1.5.4. O tag 37016-*MDInsertDate* foi acrescentado ao grupo de repetição “*Bid/Offer*” para informar a data em que a ordem foi inserida no núcleo de negociação para ordens GTD/GTC. Se não estiver presente, a data de negociação atual é considerada como válida (tag 75-*TradeDate*).

E.1.5.5. Solucionado o problema gerando *TradingSessionHighPrice* (grupo de repetição com o tag 269=7) e *TradingSessionLowPrice* (grupo de repetição com o tag 269=8) para instrumentos não-líquidos.

E.1.5.6. Eliminado o problema com o tag faltante 107-*SecurityDesc* para alguns tipos de instrumentos, como por exemplo, mercado futuro de ações.

E.1.5.7. Eliminado o problema com o tag 311-*UnderlyingSymbol* = “[N/A]” para o mercado de opções de ações.

E.1.5.8. Ajustados os atributos de instrumento para o mercado futuro de ações.





002/2011-DI

.5.

E.1.5.9. Incluída a divulgação do preço referencial de alguns tipos de instrumentos.

E.1.5.10. Incluído o valor = “3” do tag *277-TradeCondition* para indicar que uma negociação no mercado de ações à vista foi originada a partir de uma operação no mercado a termo.

E.1.5.11. Incluído o tag *286-OpenCloseSettlFlag* no grupo de repetição do *ClosingPrice* (tag 269=5) para informar se o preço de fechamento relaciona-se ao dia atual ou ao dia útil anterior.

E.1.5.12. Restaurada o estado de cada instrumento para “Aberto” no início de cada sessão de negociação. Desta forma, a fase do grupo irá definir o estado “real” de cada instrumento, sendo que as exceções se refletirão na mudança do estado do instrumento.

E.1.5.13. Corrigido o defeito de divulgação incorreta do valor do tag *6919-IndexPct* na 48ª posição do grupo de repetição *NoUnderlyings* da mensagem *SecurityList* relacionada a Índices de Ações, de forma que a soma dos valores de cada *IndexPct* deve ser sempre 100%.

E.1.5.14. Solucionado o problema relacionado à gestão do livro de ofertas quando uma parte divulgada de uma ordem com quantidade escondida for negociada e a parte seguinte for reintegrada ao livro, perdendo prioridade em relação a outras ordens com o mesmo preço de oferta. O comportamento anterior e errôneo mantinha a prioridade original, mas na verdade a ordem perde a prioridade original.

