



12 de agosto de 2011
015/2011-DO

COMUNICADO EXTERNO

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

Ref.: Nova Plataforma de Negociação Desenvolvida pela BM&FBOVESPA e o CME Group – Implantação da 1ª Etapa (Derivativos/GTS) e 3ª Sessão de Negociação Simulada em 20/08/11.

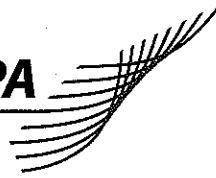
Como é de conhecimento do mercado, a Bolsa está desenvolvendo, em conjunto com o CME Group, uma plataforma eletrônica de negociação multiativos que substituirá os sistemas Global Trading System (GTS), Mega Bolsa, Bovespa Fix e Sisbex, integrando-os em um único sistema com maior capacidade de processamento, baixíssima latência e novas funcionalidades. A nova plataforma será implantada em etapas:

- 1ª Etapa: Substituição do GTS (câmbio pronto e derivativos);
- 2ª Etapa: Substituição do Mega Bolsa (ações e derivativos de ações);
- 3ª Etapa: Substituição do Bovespa Fix (títulos privados de renda fixa) e do Sisbex (títulos públicos).

A primeira etapa do desenvolvimento da nova plataforma (substituição do GTS) foi concluída e a fase de testes integrados com o mercado foi iniciada em junho de 2011. Durante a fase de testes, a Bolsa promove sessões de negociação simulada com a participação de todo o mercado, antes da implantação definitiva da plataforma em ambiente de produção. Até o momento, foram realizadas duas sessões de negociação simulada, em 25/06/2011 e 30/07/2011, abrangendo os mercados de câmbio pronto e derivativos.

1. Testes integrados da 1ª Etapa – 3ª sessão de negociação simulada

Será realizada em **20/08/2011** (sábado) a 3ª sessão de negociação simulada, abrangendo os mercados de câmbio pronto e derivativos. A participação das corretoras, dos bancos que atuam no mercado de câmbio



015/2011-DO

.2.

pronto eletrônico, de vendedores e provedores independentes de software será **obrigatória**, sendo extremamente importante a participação dos operadores de mesa.

Os participantes da sessão simulada deverão realizar os ajustes necessários em seus sistemas internos, de modo que os resultados sejam devidamente segregados das sessões regulares de negociação.

1.1 Divisão dos produtos entre a nova plataforma e o GTS

Durante a sessão de negociação simulada, os contratos de dólar pronto serão processados pela nova plataforma, enquanto os contratos de derivativos serão processados pelo sistema GTS.

A sessão simulada ocorrerá em ambiente definitivo de produção e todas as ordens e negócios realizados serão processados e difundidos aos vendedores via os protocolos de difusão atuais BELL FIX e UMDF-GTS e via o novo protocolo UMDF-nova plataforma.

O ambiente de negociação poderá ser acessado por meio do protocolo BELL FIX (via sessões de conectividade FIX e telas de negociação utilizadas atualmente) ou do novo protocolo EntryPoint.

1.2 Escopo da sessão de negociação simulada

Mercado de derivativos

O escopo da sessão de negociação simulada abrangerá:

- Assinatura e 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);
- 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:
 - Para produtos processados pelo sistema GTS: recepção de *drop copy* por meio das mesmas sessões de *drop copy* utilizadas hoje; ordens enviadas via o novo protocolo de entrada de ordens EntryPoint não estarão disponíveis em tais sessões;
 - Para produtos processados pela nova plataforma: recepção de *drop copy* disponível exclusivamente via gateway *drop copy* EntryPoint;



015/2011-DO

.3.

essa sessão não inclui *drop copy* de instrumentos processados pelo sistema GTS.

- Utilização da ferramenta de cancelamento de ofertas e-GTSX, somente para ofertas envolvendo contratos processados pelo sistema GTS;
- Recepção de notícias da negociação eletrônica;
- Interação com a BM&FBOVESPA, para que atue como contraparte ou facilite a execução do cenário de simulação específico desejado pelo participante; e
- Interação regular com a Gerência de Suporte à Negociação (GSN), por telefone (11) 2565-5333 e e-mails centrodecontrole@bvmf.com.br ou controlcenter@bvmf.com.br, e com a mesa de operações de derivativos, pelo telefone (11) 2565-4680.

Mercado de câmbio pronto

O escopo da sessão de negociação simulada abrangerá:

- Assinatura e 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);
- Recepção de mensagens de execução;
- Recepção de *drop copy* das mensagens de registro, modificação e cancelamento de ordens, e dos relatórios de execução;
- Validação de limites de negociação, levando-se em conta os limites vigentes ao final de **19/08/2011**;
- Recepção de notícias da negociação eletrônica; e
- Interação regular com a GSN, pelo telefone (11) 2565-5333 e pelos e-mails centrodecontrole@bvmf.com.br ou controlcenter@bvmf.com.br, e com a mesa de operações de câmbio pronto, pelo telefone (11) 2565-4680.

O escopo da sessão de negociação simulada **não** abrangerá, para os dois mercados:

- Recepção de arquivo XML 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;
- Apuração e difusão de preços de ajuste e cotações; e
- Produção e fornecimento de relatórios e arquivos da sessão de negociação simulada.



1.3 Interfaces a serem testadas na sessão de negociação simulada

Mercado de derivativos

Poderão ser testadas as seguintes interfaces:

- Interfaces de entrada de ordens certificadas para:
 - Protocolo BELL FIX (FIX 4.4): GLWin e GTSCClient (soluções de tela de negociação fornecidos pela Bolsa para uso exclusivo nas mesas de operações das corretoras) e soluções de tela de negociação fornecidas por provedores independentes de tecnologia ou desenvolvidas pelos participantes; e
 - Protocolo EntryPoint (FIX 4.4): soluções de tela de negociação fornecidas por provedores independentes de tecnologia ou desenvolvidas pelos participantes.
- Interfaces de difusão de *market data* certificadas para:
 - Protocolo BELL FIX (FIX 4.4) (incluídas as soluções de tela de negociação GLWin e GTSCClient);
 - Protocolo UMDF-GTS (FIX 5.0 FAST); e
 - Protocolo UMDF-nova plataforma (FIX 5.0 FAST).

Será obrigatório o teste das soluções de tela de negociação utilizadas pelas mesas de operações das corretoras, sejam estas fornecidas pela Bolsa (GLWin e GTSCClient), por provedores independentes de tecnologia ou desenvolvidas pelos participantes.

Para solicitar uma sessão de entrada de ofertas ou gateway *drop copy* via protocolo EntryPoint, deve-se contatar a Gerência de Desenvolvimento e Serviços (GDS), pelo e-mail bvmfmarketdata@bvmf.com.br ou pelo telefone (11) 2565-7105.

Os endereços *multicast* da difusão nos formatos UMDF-GTS e UMDF-nova plataforma são diferentes e estão disponíveis no site de difusão de dados de mercado da Bolsa (<http://www.bmfbovespa.com.br/marketdata>).

Os novos modelos de mensagem para teste do protocolo de difusão de *market data* UMDF-nova plataforma, válidos exclusivamente para a sessão de negociação simulada, estão disponíveis em <ftp://ftp.bmf.com.br/FIXFAST/templates/Production/>.

Mercado de câmbio pronto

Será testada a interface via solução de tela de negociação GTSCClient, fornecida pela Bolsa, e via soluções de tela de negociação fornecidas por



015/2011-DO

.5.

provedores independentes de tecnologia, tanto para entrada de ordens como para difusão de *market data*.

1.4 Atividades a serem desenvolvidas na sessão de negociação simulada

A grade de horários das fases da sessão de negociação simulada e o roteiro das atividades a serem executadas durante o teste de cada mercado (câmbio pronto e derivativos) estão disponíveis nos Anexos deste Comunicado e em www.bmfbovespa.com.br/novaplataforma.

1.5 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 do mercado de derivativos, a ser executado em **22/08/2011** (segunda-feira), a partir das 7h.

1.6 Outras informações

A participação na sessão de negociação simulada deverá ser confirmada até as 18h de **19/08/2011**, via e-mail para centrodecontrole@bvmf.com.br ou controlcenter@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 confirmação da participação, o participante receberá planilha em formato Excel contendo os roteiros dos testes, a qual deverá ser preenchida durante a execução do teste e encaminhada à Bolsa, impreterivelmente até **22/08/2011**, via e-mail para centrodecontrole@bvmf.com.br ou controlcenter@bvmf.com.br.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Operações, pelo telefone (11) 2565-4106/4680/5333, ou com Diretoria de Desenvolvimento de Sistemas de Negociação, pelo telefone (11) 2565-4524.

Atenciosamente,

Cicero Augusto Vieira Neto
Diretor Executivo de Operações e TI

**Anexo I ao Comunicado Externo 015/2011-DO****ROTEIRO PARA SESSÃO DE NEGOCIAÇÃO SIMULADA – MERCADO DE CÂMBIO PRONTO**

Este documento descreve os cenários de teste a serem utilizados pelas instituições participantes da sessão de negociação simulada, a fim de validar a migração dos instrumentos para a nova plataforma de negociação, as funcionalidades do novo sistema e a conexão a ele.

1. GRADE DE HORÁRIO - FASES DA SESSÃO SIMULADA

Horário inicial	Horário final	Fase
10:00	10:30	Confirmação de presença
10:30	10:45	Teste de conectividade
11:00	11:30	Negociação – roteiro obrigatório
11:30	12:00	Negociação – roteiro livre

Os horários mencionados na tabela referem-se ao horário de Brasília (GMT-3).

2. OFERTAS E INSTRUMENTOS ADMITIDOS**Tabela 1 - Tipos de oferta**

Oferta	Validade e qualificação
DAY / DIA	Válida somente durante o dia em que for inserida.

Tabela 2 – Instrumentos disponíveis na nova plataforma

Instrumento	Grupo	Matching engine	Tick size	Túnel de Rejeição		Tamanho máximo por oferta (US\$)	Tamanho mínimo por oferta (US\$)
				Ofertas de compra	Ofertas de venda		
USDP0000	S2	6	0,0001	± 1%	± 1%	25.000.000	250.000
USDP0001	S3	6	0,0001	± 1%	± 1%	25.000.000	250.000
USDP0002	S4	6	0,0001	± 1%	± 1%	25.000.000	250.000



015/2011-DO

.ii.

3. ROTEIRO PARA A FASE DE NEGOCIAÇÃO (OBRIGATÓRIO)**Tabela 3 – Cenários a serem executados na fase de Negociação (das 11:00 às 11:30)**

Atividade	Resultado esperado	Status	
<ul style="list-style-type: none"> • Envio de ofertas de compra para os instrumentos selecionados. • Envio de ofertas de venda para os instrumentos selecionados. 	Registro de ofertas nos livros de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta reduzindo a quantidade.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta aumentando a quantidade.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta piorando o preço.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta melhorando o preço.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Fechamento de negócios.	Negócio gerado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Inserir ofertas de compra e venda fora dos limites.	Rejeição da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de compra.	Cancelamento efetutado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda.	Cancelamento efetutado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de compra com quantidade de US\$ 25.000.000.	Registro da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de venda com quantidade de, no mínimo, US\$ 250.000.	Registro da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta sem identificação do cliente.	Recebimento de mensagem: "Preenchimento incorreto dos dados – Código do cliente requerido".	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta com identificação de cliente incorreta.	Rejeição da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta com quantidade de US\$ 26.000.000.	Rejeição da oferta. Quantidade deve ser menor ou igual ao tamanho máximo, de US\$25.000.000.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta com quantidade de US\$ 200.000.	Rejeição da oferta. Quantidade deve ser múltipla do lote-padrão (250.000).	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E

**Anexo II ao Comunicado Externo 015/2011-DO****ROTEIRO PARA SESSÃO DE NEGOCIAÇÃO SIMULADA –
MERCADO DE DERIVATIVOS – SEGMENTO BM&F**

Este documento descreve os cenários de teste a serem utilizados pelas instituições participantes da sessão de negociação simulada, a fim de validar a migração dos instrumentos para a nova plataforma de negociação, as funcionalidades do novo sistema e a conexão a ele.

Os cenários foram definidos para execução de forma sequencial, possibilitando ao participante simular situações semelhantes às de um dia de negociação.

1. GRADE DE HORÁRIO - FASES DA SESSÃO SIMULADA

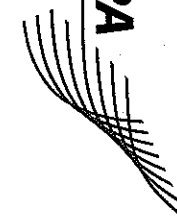
Horário inicial	Horário final	Fase
10:00	10:30	Confirmação de presença
10:30	10:45	Teste de conectividade
10:45	11:00	Pré-abertura
11:00	12:30	Negociação -- roteiro obrigatório
12:35	13:00	Call eletrônico -- roteiro obrigatório
13:05	13:10	Pré-abertura do After hours – roteiro obrigatório
13:10	14:00	Negociação – roteiro livre

2. OFERTAS E MERCADORIAS ADMITIDAS**Tabela 1 - Tipos de oferta**

Oferta	Validade e qualificação
DAY / DIA	Válida somente durante o dia em que for inserida.
FAK / EOC	Executa ou cancela. Para execução imediata contra ofertas disponíveis no book e eliminação de saldo, se existente.
FOK / TON	Tudo ou nada. Para execução total imediata contra ofertas disponíveis no livro de ofertas ou eliminação.
STOP	Oferta programada, disparada somente quando um preço específico definido na oferta é atingido

Tabela 2 - Mercadorias disponíveis no GTS

Mercadoria	Grupo	Negócio Direto	Tick size	Túnel de Rejeição		Túnel de Leilão	Tempo de leilão	Tempo de prorrogação do leilão	Última prorrogação do leilão é randômica	Quantidade máxima por oferta	Lote padrão
				Ofertas de compra	Ofertas de venda						
BGI	K1	SIM	0,01	-2; +1	-1; +2	±0,80	00:01:00	00:00:30	SIM	1.000	1
BGI	K2	NÃO	0,01	-2; +1	-1; +2	± 0,80	00:02:00	00:01:00	SIM	500	1
SFI	N3	SIM	0,01	-1,50; +1	-1; +1,50	±0,50	00:01:00	00:00:30	SIM	500	1
SFI	N4	NÃO	0,01	-1,50; +1	-1; +1,50	±0,50	00:02:00	00:01:00	SIM	500	1
ICF	L1	SIM	0,05	-6; +4	-4; +6	±3	00:01:00	00:00:30	SIM	1.000	1
ICF	L2	NÃO	0,05	-6; +4	-4; +6	±3	00:02:00	00:01:00	SIM	500	1
ETH	H2	NÃO	0,50	-30; +40	-40; +30	±10	00:02:00	00:01:00	SIM	500	1
CCM	M3	SIM	0,01	-1,30; +1	-1; +1,30	±0,50	00:01:00	00:00:30	SIM	1.000	1
CCM	M4	NÃO	0,01	-1,30; +1	-1; +1,30	±0,50	00:02:00	00:01:00	SIM	500	1
ICF	L0	NÃO	0,01	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	NÃO	500	1
BGI	K0	NÃO	0,01	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	NÃO	500	1
DOL	C1	SIM	0,5	-80; +50	-50; +80	±10	00:01:00	00:00:30	SIM	10.000	5
DOL	C2	SIM	0,5	-100; +40	-40; +100	±5	00:01:00	00:00:30	SIM	2000	5
DOL	C6	NÃO	0,5	-120; +30	-30; +120	0	00:02:00	00:01:00	SIM	1.000	5
EUR	O4	SIM	0,001	-80; +50	-50; +80	±10	00:01:00	00:00:30	SIM	10.000	5
WDL	W3	SIM	0,5	-80; +50	-50; +80	±10	00:01:00	00:00:30	SIM	500	1
EUR	O1	NÃO	0,001	-60; +30	-30; +60	0	00:02:00	00:01:00	SIM	2.000	5
IND	B1	SIM	5	-2000; +900	-900; +2000	±600	00:01:00	00:00:30	SIM	2000	5



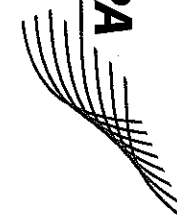
015/2011-DO

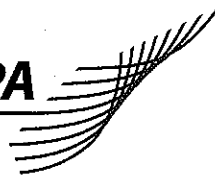
.iii.

Mercadoria	Grupo	Negócio Direto	Tick size	Túnel de Rejeição		Túnel de Leilão	Tempo de leilão	Tempo de prorrogação do leilão	Última prorrogação do leilão é randômica	Quantidade máxima por oferta	Lote padrão
				Ofertas de compra	Ofertas de venda						
IND	B2	SIM	5	-2500;+800	-800;+2500	±300	00:01:00	00:00:30	SIM	1000	5
IND	B6	NÃO	5	-3000;+500	-500;+3000	0	00:02:00	00:01:00	SIM	500	5
WIN	W1	SIM	5	-2000;+900	-900;+2000	±600	00:01:00	00:00:30	SIM	500	5
DI1	D1	SIM	0,01	-6; +6	-6; +6	±6	00:01:00	00:00:30	SIM	50.000	5
DI1	D2	SIM	0,01	-12; +12	-12; +12	±12	00:01:00	00:00:30	SIM	20.000	5
DI1	D3	NÃO	0,01	-18; +18	-18; +18	±18	00:02:00	00:01:00	SIM	10.000	5
DDI	F1	NÃO	0,01	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	SIM	5.000	10
FRC	R1	SIM	0,01	-60; +30	-30; +60	±20	00:01:00	00:00:30	SIM	10.000	10
FRC	R2	NÃO	0,01	-60; +30	-30; +60	±20	00:02:00	00:01:00	SIM	10.000	10
OZ1D	A3	NÃO	0,001	-6; +3	-3; +6	±1	00:02:00	00:01:00	NÃO	500	1
TI0	O2	NÃO	0,001	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	SIM	1.000	5
B40	O2	NÃO	0,001	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	SIM	1.000	5
DOL	C0	SIM	0,001	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	NÃO	10.000	5
DLA	C5	NÃO	0,001	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	NÃO	10.000	5
VTC	V0	NÃO	0,001	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	NÃO	10.000	5
IDI	E0	NÃO	0,01	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	NÃO	10.000	1
IND	B0	NÃO	1	ND	ND	0	00:02:00	00:01:00	NÃO	1000	5

* O grupo ilíquido é identificado pela informação "Não" na coluna Negócio Direto.

BM&FBOVESPA
A Nova Bolsa





015/2011-DO

.iv.

3. ROTEIRO PARA A FASE DE PRÉ-ABERTURA (OBRIGATÓRIO - 10:45 às 11:00)

Instrumentos envolvidos nos cenários da fase de Pré-abertura da sessão de negociação simulada

- DOLU11
- EURU11
- WDLU11
- DI1F12
- DI1F14
- DI1F20
- INDV11
- WINV11
- CCMX11
- ICFU11
- SFIK12
- BGIV11
- SFIU11

Tabela 3 – Cenários a serem executados na fase de Pré-abertura

Atividade	Resultado esperado	Status	
• Envio de ofertas de compra para todos os instrumentos indicados. • Envio de ofertas de venda para todos os instrumentos indicados.	Registro das ofertas. Formação de Preço Teórico (TOP).	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Verificação dos livros de ofertas.	Preços cruzados sem o matching.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, reduzindo a quantidade.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, piorando o preço.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra aumentando a quantidade.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra melhorando o preço.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento da oferta de compra com preço participando do teórico. Utilizar os instrumentos DOLU11 e EURU11.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço participando do teórico. Utilizar os instrumentos WDLU11 e DI1F12.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de compra com preço menor do que o preço teórico. Utilizar os instrumentos BGIV11 e ICFU11.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço maior do que o preço teórico. Utilizar os instrumentos BGIV11 e ICFU11.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta STOP para todos os instrumentos indicados.	Inclusão rejeitada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta do tipo EOC / FAK para os instrumentos BGIV11 e ICFU11.	Inclusão rejeitada	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E



015/2011-DO

.v.

Atividade	Resultado esperado	Status	
Envio de oferta do tipo TON / FOK para todos os instrumentos indicados	Inclusão rejeitada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Encerramento da fase Pré-Abertura	Geração de negócios.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E

4. ROTEIRO PARA A FASE DE NEGOCIAÇÃO (OBRIGATÓRIO - 11:00 às 12:30)

Instrumentos envolvidos nos cenários da fase de Negociação da sessão de negociação simulada

- | | | |
|----------|-----------------|-----------|
| ▪ DOLU11 | ▪ T10U11 | ▪ ICFU11 |
| ▪ DOLF12 | ▪ B40V11 | ▪ ICFU12 |
| ▪ EURU11 | ▪ DOLF12C001500 | ▪ SFIK12 |
| ▪ WDLU11 | ▪ DLAF12C001800 | ▪ BGINV11 |
| ▪ DIIF12 | ▪ VTCF12C001500 | ▪ BGIZ11 |
| ▪ DDIF12 | ▪ VCAF12C001800 | ▪ ETHV11 |
| ▪ FRCF12 | ▪ IDIF12C305000 | ▪ ETHZ11 |
| ▪ FRCF16 | ▪ INDV11 | ▪ CCMX11 |
| ▪ OZ1D | ▪ WINV11 | ▪ CCMF12 |

Tabela 4 – Cenários a serem executados na fase de Negociação

Atividade	Resultado esperado	Status	
• Visualização dos livros com ofertas da fase de pré-abertura.	Livros mostrando as ofertas inseridas durante a fase de pré-abertura e que não foram executadas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
• Envio de ofertas de compra para os instrumentos indicados. • Envio de ofertas de venda para os instrumentos indicados.	Registro de ofertas nos livros.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta reduzindo a quantidade.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta aumentando a quantidade.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta piorando o preço.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta melhorando o preço.	Modificação efetuada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Fechamento de negócios (contrapartes diferentes) com instrumento de grupo líquido com negócio na fase de pré-abertura.	Negócio gerado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Fechamento de negócio direto com instrumento do grupo líquido com negócio na fase de pré-abertura e preço dentro do spread atual.	Negócio gerado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E





015/2011-DO

.vi.

Atividade	Resultado esperado	Status	
Fechamento de negócio (contrapartes diferentes) com instrumento de grupo líquido sem negócio na fase de pré-abertura.	Geração de leilão com duração de 01 minuto.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Visualização da mensagem de leilão.	Recebimento de notícia informando os dados da operação em leilão e o horário de seu término.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de ofertas que aumentem a quantidade atendida no leilão nos 15 segundos que antecedem seu término.	Recebimento de notícia informando prorrogação do leilão.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de ofertas que aumentem a quantidade atendida no leilão nos 15 segundos que antecedem seu término.	Recebimento de notícia informando a prorrogação do leilão.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta com preço participando do preço teórico.	Cancelamento rejeitado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de compra com preço menor que o preço teórico.	Cancelamento efetuado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço maior que o preço teórico.	Cancelamento efetuado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de ofertas que aumentem a quantidade atendida no leilão nos 15 segundos que antecedem seu término.	Recebimento de notícia informando que o leilão em questão foi prorrogado e o prazo será determinado de forma aleatória.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Encerramento do leilão.	Geração dos negócios.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta sem que o instrumento esteja em leilão	Cancelamento efetuado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Fechamento de negócio direto intencional com instrumento do grupo líquido.	Inclusão de negócio rejeitada	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Fechamento de negócio direto não intencional com instrumento do grupo líquido.	Geração de leilão com duração de 02 minutos	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Visualização da mensagem de leilão.	Recebimento de notícia informando os dados da operação em leilão e o horário de seu término.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta do tipo FAK / EOC sem contraparte para atendimento parcial ou total.	Inclusão rejeitada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta do tipo FAK / EOC com contraparte para atendimento parcial.	Geração de negócio com a quantidade possível e cancelamento do saldo.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta do tipo FAK / EOC com contraparte para atendimento total.	Geração do negócio.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta do tipo FOK / TON sem contraparte para atendimento parcial ou total.	Inclusão rejeitada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta do tipo FOK / TON com contraparte para atendimento parcial.	Inclusão rejeitada.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E



015/2011-DO

.vii.

Atividade	Resultado esperado	Status	
Envio de oferta do tipo FOK / TON com contraparte para atendimento total.	Geração do negócio.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta STOP de compra.	Registro da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento da oferta STOP de compra.	Cancelamento efetuado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Geração de negócio com preço para acionamento do STOP e com quantidade de venda maior do que a oferta de compra.	Geração de negócio e registro do saldo da oferta STOP no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de compra com preenchimento do campo cliente.	Registro da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação do cliente da oferta de compra.	Modificação efetuada. Verificar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de venda executando a oferta de compra com o cliente.	Geração do negócio.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de compra com quantidade aparente.	Registro da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de compra com o mesmo preço da oferta com lote aparente.	Registro da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de venda de 100 lotes ao preço da oferta compra com lote aparente.	Geração de negócio. A próxima oferta de compra do lote aparente deverá vir abaixo da oferta que já estava no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de compra de 100 lotes com quantidade mínima de 50 lotes. Não deverá haver venda de 50 lotes que atenda a oferta de compra.	Rejeição da oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de venda com no mínimo 50 lotes.	Registro de oferta.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de oferta de compra de 100 lotes com quantidade mínima de 50 lotes.	Geração de negócio de 50 lotes. Registro do saldo da oferta de compra no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E

5. ROTEIRO PARA A FASE DE CALL (OBRIGATÓRIO - 12:35 às 13:00)

Serão realizados dois calls – um de Etanol e um de DI1. Caberá ao operador participante da sessão de negociação simulada escolher de qual participar.

Instrumentos envolvidos nos cenários para o Call de Etanol:

- ETHU11
- ETHV11



015/2011-DO

.viii.

- ETHX11
- ETHZ11

Instrumentos envolvidos nos cenários para o Call de DI1:

- DI1U11
- DI1V11
- DI1X11
- DI1Z11
- DI1F12
- DI1J12
- DI1N12
- DI1V12
- DI1F13
- DI1J13
- DI1N13
- DI1V13
- DI1F14
- DI1J14
- DI1N14
- DI1V14

Tabela 5 - Cenários a serem executados na fase de Call de Etanol

Atividade	Resultado esperado	Status	
Acompanhar mensagem, enviada pelo sistema, sobre o início do Call para a primeira chamada.	Mensagem recebida na tela de notícias.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de ofertas para a primeira chamada.	Registro das ofertas. Formação de Preço Teórico (TOP).	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, reduzindo a quantidade.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, piorando o preço.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra aumentando a quantidade.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra melhorando o preço.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento da oferta de compra com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de compra com preço menor do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço maior do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Encerramento do Call para a primeira chamada.	Geração de negócios.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E



015/2011-DO

.ix.

Atividade	Resultado esperado	Status	
Acompanhar mensagem, enviada pelo sistema, sobre o início do Call para a segunda chamada..	Mensagem recebida na tela de notícias.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de ofertas para a segunda chamada.	Registro das ofertas. Formação de Preço Teórico (TOP).	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, reduzindo a quantidade.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, piorando o preço.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra aumentando a quantidade.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra melhorando o preço.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento da oferta de compra com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de compra com preço menor do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço maior do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Encerramento do Call para a segunda chamada.	Geração de negócios.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Acompanhar mensagem, enviada pelo sistema, sobre o início do Call para a terceira chamada.	Mensagem recebida na tela de notícias.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de ofertas para a terceira chamada.	Registro das ofertas. Formação de Preço Teórico (TOP).	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, reduzindo a quantidade.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, piorando o preço.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra aumentando a quantidade.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra melhorando o preço.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento da oferta de compra com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E



015/2011-DO

.X.

Atividade	Resultado esperado	Status	
Cancelamento de oferta de venda com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de compra com preço menor do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço maior do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Encerramento do Call para a terceira chamada.	Geração de negócios.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Acompanhar mensagem, enviada pelo sistema, sobre o início do Call para a quarta chamada.	Mensagem recebida na tela de notícias.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Envio de ofertas para a quarta chamada.	Registro das ofertas. Formação de Preço Teórico (TOP).	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, reduzindo a quantidade.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de oferta dentro do preço teórico, piorando o preço.	Rejeição de modificação.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra aumentando a quantidade.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Modificação de ofertas de compra melhorando o preço.	Modificação efetuada. Visualizar posição no livro de ofertas.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento da oferta de compra com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço participando do teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de compra com preço menor do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Cancelamento de oferta de venda com preço maior do que o preço teórico.	Cancelamento recusado.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Encerramento do Call.	Geração de negócios.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E

6. ROTEIRO PARA A FASE DE PRÉ-ABERTURA DO AFTER-HOURS (OBRIGATÓRIO – 13:05 às 13:10)

Instrumentos disponíveis para simulação na fase de Pré-abertura do After-hours:

- BGIX11
- BGIU11
- CCMX11
- CCMF12
- ICFZ11
- SFIU11
- SFIK12
- ETHF12



015/2011-DO

.xi.

- ICFU12

Tabela 6 - Cenários a serem executados na fase de Pré-abertura do After-hours

Atividade	Resultado esperado	Status	
Verificação dos campos PreMax e PreMin na janela Resumo de mercado (GL)	Limpeza das informações da sessão anterior.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
• Envio de ofertas de compra para os instrumentos agrícolas. • Envio de ofertas de venda para os instrumentos agrícolas.	Registro das ofertas. Formação de Preço Teórico (TOP).	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Verificação dos livros de ofertas.	Visualização das ofertas enviadas pelos participantes.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E
Verificação de leilão de primeiro negócio do dia (para mercadorias sem negócio na Pré abertura)	Disparo de leilão.	<input type="checkbox"/> OK	<input type="checkbox"/> N/E

7. FASE DE NEGOCIAÇÃO LIVRE

Instrumentos disponíveis para simulação na fase de Negociação livre (das 13:10 às 14:00):

- BGIX11
- BGIV11
- CCMX11
- CCMF12
- ICFU12
- ICFZ11
- DIIN12
- DIIF16
- DIIF19
- DIIF21
- DOLU11
- DOLZ11
- DOLJ12
- DOLF13
- EURU11
- EURF13
- FRCF13
- FRCF16
- FRCF20
- FRCF21
- WINQ11
- OZ2D
- OZ3D
- SFIU11
- SFIK12
- AUDU11
- CADU11
- DDMF13
- ETHF12
- ETHX11
- DOLH12C001900
- IDIF12C343500
- INEQ11C045000
- INEQ11P051000
- DOLG12C001500
- BOZ1F12011000