



18 de junho de 2024  
036/2024-VNC

## COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Market Data e EntryPoint: novos campos e domínios para lançamento da funcionalidade Sweep and Cross**

Como parte da preparação para o lançamento de produtos e funcionalidades para negociação, e visando auxiliar o planejamento dos participantes, vendedores e comitentes, comunicamos a atualização nas especificações técnicas dos Dicionários FIX e Binário da interface de entrada de ofertas EntryPoint, do Market Data e dos dicionários das plataformas, conforme descrito a seguir.

### **Nova funcionalidade: Sweep and Cross**

Sweep and Cross refere-se a uma estratégia de execução de ordens no mercado financeiro que envolve duas etapas principais: **(i)** a etapa "sweep", que consiste em executar ordens contra todas as ofertas disponíveis no livro de ordens central até determinado preço, buscando a melhor execução possível; e **(ii)** após essa varredura, a etapa "cross", realizada onde uma ordem direta é registrada. A nova funcionalidade Sweep and Cross da B3 permitirá ao intermediário realizar a execução das duas etapas com o envio de apenas uma oferta.

Essa funcionalidade **está sujeita à aprovação do regulador**. As datas de implementação no ambiente de certificação e de lançamento serão informadas oportunamente.

036/2024-VNC

Serão atualizadas as especificações descritas a seguir para suportar a nova funcionalidade.

**EntryPoint****a) Novo domínio na tag 549 – CrossType**

Criação do domínio abaixo para as mensagens que têm a tag 549 – CrossType.

<b>Domínio</b>	<b>Descrição</b>
<b>4</b>	<b>Sweep and Cross:</b> A cross order that can be executed against existing orders in the order book up to a limited price and a sweep quantity followed by a cross order. Basically, the client selects one side of the cross order that will be executed against existing orders on the other side of the book, as long as the price in the order book is better or the same as the price in the cross order. Any remaining or total amount that is not executed in the order book will be executed by the cross order

**b) Novos domínios na tag 550 – CrossPrioritization**

Criação dos domínios abaixo para as mensagens que têm a tag 550 – CrossPrioritization.

<b>Domínio</b>	<b>Descrição</b>
<b>1</b>	Buy side is prioritized
<b>2</b>	Sell side is prioritized

**c) Inclusão da tag opcional 35115-maxSweepQty**

Inclusão da tag responsável por limitar quantidade máxima para o Sweep.

<b>Tag</b>	<b>Descrição</b>
<b>35115</b>	Maximum sweep quantity

**d) Alteração da mensagem Execution Report (35=8)**

Inclusão das tags abaixo no Execution Report, com as mesmas características das tags na mensagem NewOrderCross(35=s).

<b>Tag</b>	<b>Descrição</b>
<b>549</b>	CrossType
<b>550</b>	CrossPrioritization
<b>35115</b>	MaxSweepQty

**e) Criação de novo domínio na tag 378-ExecRestatementReason**

<b>Domínio</b>	<b>Descrição</b>
<b>210</b>	Cancel remaining from Sweep and Cross

**Market Data****a) Novo domínio na tag 277-TradeCondition – Protocolo FIX**

Mensagens Incremental(35=X) e Snapshot(35=W): criação do domínio abaixo para as mensagens que têm a tag 277 – TradeCondition.

<b>Domínio</b>	<b>Descrição</b>
<b>SW</b>	Sweep

**b) Novo domínio na tag 829 - TrdSubType – Protocolo Binário**

Criação do domínio abaixo para as mensagens que têm a tag 829 – TrdSubType.

<b>Domínio</b>	<b>Descrição</b>
109	SWEEP_TRADE: Sweep Trade (SW)



036/2024-VNC

As especificações técnicas do EntryPoint, bem como o Dicionário FIX (os dicionários FIX de Equities e Derivativos foram unificados em um único arquivo), já estão disponíveis em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Soluções, Plataformas, Puma Trading System, Desenvolvedores e vendedores, EntryPoint – Order Entry FIX.

As especificações técnicas do Binário também estão disponíveis em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Soluções, Plataformas, Puma Trading System, Desenvolvedores e vendedores, EntryPoint – Order Entry Binário.

As especificações técnicas do Market Data já estão disponíveis em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Soluções, Plataformas, Puma Trading System, Desenvolvedores e vendedores, Market Data FIX/FAST.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com o Atendimento B3 – Listados, pelo telefone (11) 2565-5021 ou pelo e-mail [suporteanegociacao@b3.com.br](mailto:suporteanegociacao@b3.com.br).

Mario Palhares

Vice-Presidente de Operações – Negociação Eletrônica e CCP