

GLOSSÁRIO

Dados Públicos

SUMÁRIO

1	INTRODUÇÃO.....	3
2	DESCRIÇÃO DO DADO.....	3
3	LEIAUTE, TERMOS E DEFINIÇÕES	3
4	REGISTRO DE ALTERAÇÕES.....	4

1 INTRODUÇÃO

Este glossário define o significado dos termos e das siglas contidas nos arquivos de dados regulatórios disponibilizados no site da B3 e divulgados em conformidade com a política de dados regulatórios da B3, também disponível no site da B3.

A tabela apresentada mais abaixo contempla a definição dos termos utilizados no arquivo MarginScenarioLiquidAssetsFile (Cenários de Margem para Ativos Líquidos).

2 DESCRIÇÃO DO DADO

O arquivo Cenários de Margem para Ativos Líquidos (CENLIQWEB) informa para todos os Fatores Primitivos de Risco (FPRs) os cenários referenciais de mercado (9998), os cenários de alta (9999) e os cenários de baixa (10000), para os 10.000 cenários de estresse do CORE (Clouseout Risk Evaluation), no horizonte do segundo dia de encerramento (HP2).

A divulgação dos dados é realizada diariamente, referente aos dados do pregão anterior. O arquivo é disponibilizado em formato CSV.

3 LEIAUTE, TERMOS E DEFINIÇÕES

#	Código	Termo PT	Termo EN	Descrição do termo.
1	RptDt	DataDoRelatório	ReportDate	Data de referência da informação.
2	PRFNm	NomeFPR	PRFName	Nome do FPR. No caso das Volatilidades, é o nome da FPR + o delta. Exemplo: Volatilidade VLPETR4 VLPETR41 = Volatilidade VLPETR4 + Delta 1 VLPETR499 = Volatilidade VLPETR4 + Delta 99
3	VrtxCd	CodigoVertice	VertexCode	Vértice / Código da Distribuição No caso de curvas e da volatilidade, o valor refere-se ao vértice. No caso de preço de referência, o valor refere-se ao código da distribuição. Nos outros casos, o valor é zero. Exemplo:

				Curva CUPOM - Vértices: 1, 28, 58, 91, ... Preço de Referência PETR4: Código de Distribuição 196
4	Scnroid	IdCenario	Scenarioid	Identificação dos cenários: - 9998: cenário neutro - 9999: cenário do envelope de alta - 10000: cenário do envelope de baixa
5	PRFVal	ValorFPR	PRFValue	É o valor do FPR com o choque já aplicado. Exemplo FPR PETR4: Cenário 9998: Valor: +00000000000281800 = 28,1800 Cenário 9999: Valor: +00000000000352250 = 35,2250 Cenário 10000: Valor: +00000000000211349 = 21,1349 Com Sinal; 4 decimais
6	TpShck	TipoChoque	TypeShock	Tipo de Choque Domínio: A - Aditivo M - Multiplicativo

4 REGISTRO DE ALTERAÇÕES:

Versão	Item Modificado	Modificação	Motivo	Data
1	-	-	Versão Inicial.	fevereiro/2020
1.1	Descrição do dado	Inclusão	-	Outubro/2023