

GLOSSÁRIO

Dados Públicos

SUMÁRIO

1	INTRODUÇÃO.....	3
2	DESCRIÇÃO DO ARQUIVO	3
3	TERMOS E DEFINIÇÕES	3
4	OBSERVAÇÃO	5
5	REGISTRO DE ALTERAÇÕES.....	5

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 abaixo contempla a definição dos termos utilizados na tabela “Negócio a Negócio”, disponível na subseção “Renda Fixa”, que por sua vez está inserida na seção “Balcão” do Boletim Diário do Mercado, disponível no link https://www.b3.com.br/pt_br/market-data-e-indices/servicos-de-dados/market-data/consultas/boletim-diario/boletim-diario-do-mercado/.

2 DESCRIÇÃO DO ARQUIVO

O arquivo tem como objetivo dar publicidade aos negócios realizados ao longo do dia, com intervalo de atualização de até 15 minutos, sendo que, ao final do dia, é disponibilizado um arquivo contendo todos os negócios realizados naquela data.

A tabela abaixo descreve todos os campos existentes no arquivo, de forma que a ordem dos campos respeita a sequência em que as colunas são apresentadas no arquivo.

3 TERMOS E DEFINIÇÕES

#	Termo PT	Termo EN	Descrição do Termo	Formato do Campo
1	Instrumento Financeiro	Instrument Type	Código que identifica o tipo de instrumento negociado. Serão disponibilizados dados dos seguintes tipos de instrumento financeiro: - CDCA (Certificado de Direitos Creditórios do Agronegócio) - CFF (Fundos Fechados) - COE (Certificado de Operações Estruturadas) - CRA (Certificado de recebíveis do agronegócio) - CRI (Certificado de recebíveis imobiliários) - DEB (Debêntures) - LF (Letra Financeira) - LFS (Letra Financeira subordinada) - LFSN (Letra Financeira elegível – Nível II) - LFSC (Letra Financeira elegível – Capital Complementar) - LFV (Letra Financeira vinculada) - LIG (Letra Imobiliária garantida) - NC (Nota Comercial)	Campo texto
2	Emissor	Issuer	Indica o nome do emissor do instrumento financeiro.	Campo texto
3	Código IF	Ticker Symbol	Código que identifica o instrumento financeiro negociado.	Campo alfanumérico
4	Quantidade Negociada	Traded Quantity	Quantidade negociada do Instrumento financeiro.	Campo numérico

5	Preço Negócio	Traded Price	Preço do ativo negociado.	Campo numérico
6	Volume Financeiro (R\$)	Financial Volume (R\$)	Volume Financeiro total movimentado no negócio, em Reais.	Campo numérico
7	Taxa Negócio	Traded Rate	Taxa do Negócio. Para os ativos que são negociados em PU, podem existir situações em que não exista o cálculo da taxa equivalente. Nestas situações, o campo será exibido em branco.	Campo numérico
8	Origem Negócio	Trade Origin	Forma de lançamento do negócio: - Pré-Registro – Voice (apenas na plataforma Trader), - Negociação – Tela (apenas na plataforma Trader) e - Registro (apenas na plataforma NoMe)	Pre-Registro – Voice: Apenas para DEB, CRA, CRI, CFF Negociação – Tela: Apenas para DEB, CRA, CRI, CFF Registro: Para os demais instrumentos
9	Horário Negócio	Trade Time	Horário que o negócio foi realizado/lançado na plataforma	Padrão UTC com Time Zone (UTC-3)
10	Data Negócio	Trade Date	Data do negócio	Campo data (DD/MM/AAAA)
11	Cód. Identificador do Negócio	Trade Identification Code	Código de identificação único do negócio lançado/realizado.	Campo alfanumérico
12	Código Isin	ISIN Code	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada instrumento financeiro um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7, onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL; b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor; c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de instrumento financeiro, podendo ter sequência automática na segunda posição (sequência 1) e na terceira posição (sequência 2) ou não ter qualquer sequência; d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma sequência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias; e) o último caractere (7) é o dígito de controle. Caso o instrumento financeiro não tenha código ISIN cadastrado, o campo será exibido em branco.	Campo alfanumérico
13	Data Liquidação	Settlement Date	Data em que ocorre a liquidação do negócio. Permite identificar se a operação tem liquidação à vista, ou seja, na mesma data de referência do arquivo ou a Termo, em data futura diferente da data de referência do arquivo analisado, conforme regras disponíveis nos manuais de operação do balcão	Campo data (DD/MM/AAAA)
14	Situação do Negócio	Trade Status	Indica o status do negócio. Opções: - Confirmado - Cancelado -Ajustado B3 - Cancelado B3	Confirmado Cancelado Ajustado B3: Negócios realizados no subsistema de registro – NoMe sem lançamento correspondente na Plataforma Eletrônica.

				Cancelado B3: Negócio realizado na Plataforma Eletrônica sem operação correspondente no Subsistema de Registro - NoMe
--	--	--	--	--

4 OBSERVAÇÃO

O arquivo apresenta de maneira detalhada e tempestiva os negócios definitivos e a termo para os seguintes valores mobiliários:

CDCA PÚBLICA, CFF DEPOSITADO, CRA PÚBLICO, CRI PÚBLICO, COE PÚBLICO, DEB DEPOSITADA, LF PÚBLICA, LFS PÚBLICA, LFSC PÚBLICA, LFSN PÚBLICA, LFV PÚBLICA, LIG PÚBLICA, NC DEPOSITADA.

Para debêntures (DEB), cotas de fundos fechados (CFF), certificados de recebíveis imobiliários (CRI) e certificados de recebíveis do agronegócio (CRA) são capturados os negócios à vista (operação tipo 52) e a termo (operação tipo 552) da plataforma de negociação (Trader), de forma que tanto aqueles provenientes de negociação em tela como aqueles realizados via pré-registro são apresentados.

Para os demais ativos (CDCA, LF, LFS, LFSN, LFSC, LFV, LIG, COE, NC) são capturadas as operações de compra e venda definitiva à vista (operação tipo 52) e a termo (operação tipo 552) da plataforma de registro e depositária (NoMe).

Também é disponibilizado um indicador para sinalizar se o negócio previamente exibido no arquivo com o status confirmado, foi posteriormente cancelado. Desta forma, é possível que o usuário identifique a situação do negócio.

A respeito da correspondência exata entre o Arquivo Negócio a Negócio (Dados Detalhados) e o arquivo Registros Consolidados (Dados Agregados) é importante esclarecer que, após a realização de um negócio ou de informação de condições contratadas na plataforma de negociação no módulo Voice ("Negócios"), é possível ao participante realizar a alocação das quantidades negociadas em diferentes registros no Subsistema de Registro (plataforma NoMe), de maneira que o número de negócios na plataforma de negociação não corresponda ao número total de operações lançadas Subsistema de Registro.

Adicionalmente, a B3 poderá realizar ajustes, em D+1, das informações dos negócios realizados com intuito de exibir apenas aqueles que efetivamente tiveram o registro finalizado no Subsistema de Registro.

5 REGISTRO DE ALTERAÇÕES

Versão	Item Modificado	Modificação	Motivo	Data
1	-	-	Versão Inicial.	Novembro/2022
2	Todo o documento	Reorganização do documento, inclusão de campo para identificação da situação do negócio	Atualização de formato do arquivo.	Março/2023
3	Todo o documento	Inclusão de menção à divulgação de informações de negociação apenas de CFFs, DEBs e NCs cujo regime seja igual a Depositado. Exclusão das informações de CBIO Inclusão de menção à ajustes nos dados dos negócios no dia útil posterior a operação e a criação de duas novas situações: Ajustado B3 e Cancelado B3.	Aumentar a acurácia da informação disponibilizada. Os dados de CBIO estão centralizados em página específica do site da B3.	Dezembro/2023