

GLOSSÁRIO

Dados Públicos

SUMÁRIO

1	INTRODUÇÃO.....	3
2	DESCRIÇÃO DO DADO.....	4
3	DEFINIÇÕES.....	5
4	REGISTRO DE ALTERAÇÕES.....	6

1 INTRODUÇÃO

Neste glossário buscaremos abordar as regras gerais aplicadas para a apuração do Volume Financeiro (em reais) e Quantidade de Contratos para os seguintes produtos:

- Derivativos de Balcão Com Garantia (Com CCP): Termo, Swap e Opção;
- Derivativos de Balcão Sem Garantia (Sem CCP): Termo, Swap, Opção e instrumentos BOX e COE.

É importante ressaltar que as regras abordadas podem variar de acordo com algumas particularidades de Produtos.

2 DESCRIÇÃO DO DADO

No site, fornecemos informações sobre o Volume Financeiro (em reais) e a Quantidade de Contratos, tanto na visão Estoque quanto na visão Registro/Movimento diário.

Os dados são divulgados diariamente, permitindo aos usuários acompanharem de perto as atividades do mercado financeiro.

3 DEFINIÇÕES

VOLUME FINANCEIRO

O valor financeiro do contrato será apresentado conforma a seguir:

Derivativo de Balcão sem CCP	Valor Financeiro (em reais)
Termo	Ativo Subjacente cotado em Reais = (Valor Base Remanescente_Quantidade x Taxa a Termo) Ativo Subjacente cotado em Moeda Estrangeira = (Valor Base Remanescente_Quantidade x Taxa a Termo x Cotação da Moeda/BRL)
Swap	Equivale ao Valor Base Remanescente
Opção	Ativo Subjacente cotado em Reais = (Quantidade Remanescente x Preço de Exercício) Ativo Subjacente cotado em Moeda Estrangeira = (Quantidade Remanescente x Preço de Exercício x Cotação da Moeda/BRL)
BOX	Equivale ao Valor da Aplicação
COE	Equivale ao Valor Financeiro de Emissão
Derivativo de Balcão com CCP	Valor Financeiro (em reais)
Termo	Ativo Subjacente cotado em Reais = (Valor Base Remanescente_Quantidade x Taxa a Termo) Ativo Subjacente cotado em Moeda Estrangeira = (Valor Base Remanescente_Quantidade x Taxa a Termo x Cotação da Moeda/BRL)
Swap	Equivale ao Valor Base Remanescente
Opção	Ativo Subjacente cotado em Reais = (Quantidade Remanescente x Preço de Exercício) Ativo Subjacente cotado em Moeda Estrangeira = (Quantidade Remanescente x Preço de Exercício x Cotação da Moeda/BRL)

Observações:

- 1) As cotações Moeda/BRL referem-se a D-1 da data do arquivo, ou seja, D-2 da data da consulta no site.
- 2) Serão considerados apenas contratos ativos

QUANTIDADE DE CONTATOS

Entende-se por Quantidade o número de códigos de instrumentos financeiros de cada produto.

Observações:

- 1) Serão considerados apenas contratos ativos

4 REGISTRO DE ALTERAÇÕES

Versão	Item Modificado	Modificação	Motivo	Data
1	-	-	Versão Inicial.	Dez/2023