

GLOSSÁRIO

Dados Públicos

SUMÁRIO

1	INTRODUÇÃO.....	3
2	DESCRIÇÃO DO ARQUIVO	3
3	TERMOS E DEFINIÇÕES	3
4	OBSERVAÇÃO	5
5	REGISTROS DE ALTERAÇÕES	6

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 Registros_Consolidados_Balcao (Registros Consolidados de Balcão - OTCTradeInformationConsolidatedFile), disponível na página do boletim BD BDI, link https://www.b3.com.br/pt_br/market-data-e-indices/servicos-de-dados/market-data/consultas/boletim-diario/boletim-diario-do-mercado/ - seção Renda Fixa.

2 DESCRIÇÃO DO ARQUIVO

O arquivo Registro Consolidado de Balcão tem, como principal objetivo, dar publicidade aos dados de Registro de negócios de Valores Mobiliários de Renda Fixa, através da visualização consolidada de todas as operações realizadas naquela data:

- De compra e/ou venda definitiva à vista
- De compra e/ou venda definitiva a termo

O arquivo é disponibilizado diariamente no fechamento do dia, contendo dados de negociação realizadas no dia (D0), em formato CSV. Os dados são exibidos de maneira agrupada pelas colunas “Código IF”, “Data Liquidação” e “Classificação dos Negócios”.

3 TERMOS E DEFINIÇÕES

#	Termo PT	Termo EN	Descrição do Termo	Formato do Campo
1	Data Negócio	Trade Date	Indica o dia em que os negócios ocorreram.	Campo data (DD/MM/AAAA)
2	Instrumento Financeiro	Instrument Type	Código que identifica o tipo de instrumento negociado. Serão disponibilizados dados dos seguintes tipos de instrumento financeiro: - CBIO (Crédito de Descarbonização) - 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)	Campo texto

			<ul style="list-style-type: none"> - LFSC (Letra Financeira elegível – Capital Complementar) - LFV (Letra Financeira vinculada) - LIG (Letra Imobiliária garantida) - NC (Nota Comercial) 	
3	Código IF	Ticker Symbol	Código que identifica o instrumento financeiro negociado.	Campo alfanumérico
4	Código ISIN	ISIN Code	<p>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:</p> <ul style="list-style-type: none"> 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
5	Emissor	Issuer	Indica o nome do emissor do instrumento financeiro.	Campo texto
6	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)
7	Quantidade Negociada	Traded Quantity	Indica a quantidade total do instrumento financeiro negociado no dia, para o agrupamento em questão.	Campo numérico
8	Preço Mínimo	Min Price	Preço mínimo observado no dia, considerando o agrupamento em questão.	Campo numérico
9	Preço Médio	Average Price	Preço médio dos negócios do dia. É realizada a média ponderada dos negócios ocorridos no dia, considerando o agrupamento em questão.	Campo numérico
10	Preço Máximo	Max Price	Preço máximo observado no dia, considerando o agrupamento em questão.	Campo numérico
11	Último Preço	Last Price	Último preço observado para o instrumento financeiro, independente dos agrupamentos.	Campo numérico
12	Preço de Referência	Reference Price	<p>Indica o preço de referência para o instrumento financeiro, independente dos agrupamentos. A determinação do preço de referência seguirá a seguinte metodologia:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1) MtM calculado, caso o instrumento financeiro possua preço de marcação a mercado calculado pela B3 (conforme metodologia disponível no site 	Campo numérico

			da B3, no link: Manual de Apreçamento de Debêntures); ou 2) Preço médio ponderado, considerando todos os negócios que ocorreram com o instrumento financeiro na data, independente dos agrupamentos existentes, caso não haja MtM calculado para o instrumento financeiro.	
13	Número de Negócios	Number of Contracts Traded	Quantidade de negócios realizados no dia, considerando o agrupamento em questão.	Campo numérico
14	Volume Financeiro (R\$)	Financial Volume (R\$)	Volume financeiro total negociado no dia em R\$, considerando o agrupamento em questão.	Campo numérico
15	Classificação do Negócio	Classification Type	Indica o tipo de classificação para o negócio realizado, se intragrupo, extragrupo. - Intragrupo : classificação dada para negócios em que o grupo econômico do comprador é o mesmo que o grupo econômico do vendedor. Negócios realizados entre fundos de gestores pertencentes ao mesmo grupo econômico, através de intermediação de uma mesma instituição, são considerados intragrupo, desde que a quantidade negociada seja a mesma nas duas pontas do negócio. - Extragrupo : classificação dada para negócios em que o grupo econômico do comprador é diferente do grupo econômico do vendedor. - "-": Não há identificação intra e extra grupo para as negociações.	Campo texto
16	Oscilação	Oscillation	Indica a oscilação observada entre o último preço de D-1 e o último preço de D0. No caso de ocorrência de pagamento de eventos para o instrumento financeiro em questão em D0, os preços unitários pagos nos respectivos eventos são descontados do último preço de D-1.	Campo Percentual

4 OBSERVAÇÃO

O arquivo apresenta de maneira consolidada os registros de operações definitivas à vista e a termo, realizados na plataforma de registro e depositária (NoMe) para os seguintes valores mobiliários:

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

A respeito da correspondência exata entre o Arquivo Negócio a Negócio (Dados Detalhados) e o arquivo Registros Consolidados (Dados Agregados) é importante registrar o seguinte: em razão de duas hipóteses específicas, abaixo identificadas, existe a possibilidade de o volume ou o número de negócios identificados no Arquivo Negócio a Negócio (que utiliza a plataforma de negociação como fonte dos dados de alguns instrumentos financeiros) não corresponder ao valor registrado no Arquivo Registros Consolidados (que

utiliza a plataforma de registro e depositária como fonte dos dados de todos os instrumentos financeiros) ao final do dia. Tais hipóteses são as seguintes:

- Após a realização de um pré registro na plataforma de negociação, é possível ao cliente alocar os ativos negociados em diferentes registros na plataforma de Registro/Depositária NoMe, de maneira que o número de negócios de um não corresponda ao de outro;
- Em alguns casos de intermediação, não há a obrigação ao cliente de realizar o pré registro na plataforma de negociação em sua completude, de acordo com o comunicado CCETIP2015-112, de maneira que o número de negócios realizados, seu volume e quantidade negociada, deixem de apresentar parte da correspondência com o registro.

Podem ocorrer outras situações de exceção que resultem em diferença nos arquivos e que se dão devido ao ciclo de vida dessas operações. Estes casos são devidamente analisados e tratados pela B3.

5 REGISTROS DE ALTERAÇÕES

Versão	Item Modificado	Modificação	Motivo	Data
1	-	-	Versão Inicial.	Outubro/2019
2	1	Inclusão dos campos OperationClassificationType e Name e OperationClassificationType e Code	Atualização do Glossário	Setembro/2021
3	1	Inclusão de observação	Inclusão da explicação detalhada da fonte dos dados	Dezembro/2021
4	1	Inclusão de observação	Inclusão da explicação detalhada sobre intragrupo e extragrupo	Julho/2022
5	1	Inclusão do campo NationalFinancialVolume	Resolução 135 da CVM	Outubro/2022
6	1	Inclusão dos campos "Tipo Instrumento", "Emissor" e "Data Liquidação" Exclusão dos campos AdjustedQuote e OperationClassificationType e Code	Resolução 135 da CVM	Dezembro/2022
7	Todo o documento	Reorganização do documento, inclusão de novos campos	Atualização de formato do arquivo. Inclusão de campos para atender a Resolução 135 da CVM	Março/2023

8	Tópico 2	Descrição do Arquivo	Ajuste no último parágrafo	Abril/2023
---	----------	----------------------	----------------------------	------------