

# GLOSSÁRIO DERIVATIVOS DE BALCÃO

Dados Públicos

## SUMÁRIO

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

## 1 INTRODUÇÃO

Este glossário visa esclarecer as terminologias, definições e regras aplicáveis à apuração do Volume Financeiro (em reais) e da 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;

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

## 2 DESCRIÇÃO DO DADO

Os dados disponíveis no sistema contemplam o Volume Financeiro e a Quantidade de Contratos dos Derivativos de Balcão. Esses dados são apresentados em duas perspectivas: Estoque e Registro (Movimento Diário).

### 3 DEFINIÇÕES

#### VOLUME FINANCEIRO

O Volume Financeiro dos Derivativos de Balcão corresponde à soma dos valores financeiros de todos os contratos, segmentada por tipo de produto.

A seguir, detalhamos os métodos de cálculo aplicáveis a cada produto derivativo:

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

A Quantidade de Contratos corresponde ao total de instrumentos financeiros gerados a partir de cada contrato registrado, separados por tipo de produto.

**Observações:**

- 1) Apenas contratos ativos são considerados nessa contagem
- 2) Cada contrato é identificado de forma única pelo seu código específico no sistema.

## 4 REGISTRO DE ALTERAÇÕES

| Versão | Item Modificado | Modificação                                              | Motivo                                       | Data       |
|--------|-----------------|----------------------------------------------------------|----------------------------------------------|------------|
| 2      | COE             | O COE foi retirado do Glossário de Derivativos de Balcão | O COE tem uma consulta própria dentro do BDI | Março/2025 |
| 1      | -               | -                                                        | Versão Inicial                               | Dez/2023   |