

29 de abril de 2020

053/2020-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados da B3 – Segmentos BM&FBOVESPA, Cetip UTMV e Cetip UFIN – Vendors, Provedores de DMA e Provedores Independentes de Software (ISV)

Ref.: **Serviços de Dados – Lançamento do Novo Canal de Dados de Precificação de Debêntures no UP2DATA**

A B3 informa que, a partir da data de publicação deste Ofício Circular, disponibilizará o novo canal de dados de debêntures no UP2DATA, visando o desenvolvimento do mercado brasileiro de renda fixa privada.

Esse novo canal disponibiliza: (i) dados cadastrais, agenda com fluxos de pagamentos e negócios diários do mercado secundário para todas as debêntures de emissões públicas; e (ii) preço de referência diário para mais de 900 debêntures seguindo metodologia de apreçamento desenvolvida pela B3.

A metodologia de apreçamento de debêntures tem dois pilares: preços negociados e atribuição, pela B3, de perfil de risco de crédito. A B3 atribui um perfil de risco de crédito para todas as debêntures elegíveis ao apreçamento, entretanto, essa informação não será disponibilizada ao mercado.

Os preços de referência de debêntures cujas negociações superaram determinados critérios de liquidez serão seus respectivos preços médios observados no dia. Tais debêntures são agrupadas de acordo com o perfil de risco de crédito. Para cada perfil, é estimada uma curva de spread de risco de crédito.

Para cada curva de spread de risco de crédito, são associadas as debêntures do perfil que não foram negociadas ou que não atenderam aos critérios de liquidez no dia. O preço de referência de cada uma dessas debêntures resulta do seu

053/2020-PRE

fluxo de caixa descontado pela curva resultante do seu spread de risco de crédito e da taxa de juro livre de risco de seu indexador.

O manual de apreçamento, contendo mais detalhes sobre as metodologias de precificação e de atribuição de perfis de risco de crédito, pode ser consultado em www.b3.com.br/up2data.

Ressaltamos que os dados serão disponibilizados gratuitamente até 31/03/2021.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a área de Governança e Serviços de Dados, pelo telefone (11) 2565-5111 ou pelo e-mail dataservices@b3.com.br.

Para contratação do novo canal e informações sobre a política comercial, contatar a área de Produtos de Dados, pelo telefone (11) 2565-7908 ou pelo e-mail produtosdedados@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes