

20 de setembro de 2022  
117/2022-PRE

## OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado e Balcão B3

Ref.: **Criação da solução Índices on Demand e lançamento do Índice CBIO B3**

A B3 informa que, em **20/09/2022**, disponibilizará Índices on Demand em seu site institucional, solução destinada a oferecer índices de forma rápida ao mercado. Com isso, o investidor poderá visualizar índices de diferentes segmentos do mercado brasileiro e agregar maior diversificação a sua carteira.

A princípio, os dados serão oferecidos por meio de arquivo para download na página [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Market Data e Índices, Índices, Índices on Demand. Além do cálculo dos índices em pontos, o arquivo conterá a metodologia e a carteira teórica para cada novo produto.

A nova página estreia com o lançamento de mais um índice do Balcão a ser calculado pela B3, o ICBIO B3.

Esse índice indica o desempenho do preço médio do crédito de descarbonização (CBIO), ativo registrado na B3.

Além disso, o índice será disponibilizado uma vez ao dia, sempre considerando os registros de CBIO em sua respectiva data de referência (seguindo o calendário do Balcão B3).



117/2022-PRE

A metodologia do ICBIO B3 está detalhada no Anexo deste Ofício Circular e em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Market Data e Índices, Índices de Segmentos e Setoriais.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos pelo e-mail [derivativosequities@b3.com.br](mailto:derivativosequities@b3.com.br).

Gilson Finkelsztain  
Presidente

José Ribeiro de Andrade  
Vice-Presidente de Produtos e Clientes

## **Anexo do OFÍCIO CIRCULAR 117/2022-PRE**

### **Metodologia do índice CBIO B3**

#### **1. OBJETIVO**

O índice CBIO B3 (ICBIO B3) é o indicador de desempenho do preço médio ponderado e ajustado do crédito de descarbonização (CBIO) registrado na B3, elaborado de acordo com os critérios estabelecidos nesta metodologia.

#### **2. TIPO DE ÍNDICE**

O ICBIO B3 é um índice de retorno de preço que considera a variação do preço médio ponderado e ajustado.

#### **3. ATIVOS ELEGÍVEIS**

O ICBIO B3 é composto de CBIOs registrados nos ambientes da B3.

#### **4. CRITÉRIOS DE INCLUSÃO**

Serão selecionados todos os CBIOs registrados nos ambientes da B3.

#### **5. SEGMENTO**

Balcão.

## 6. CÁLCULO DO PREÇO MÉDIO PONDERADO E AJUSTADO

O cálculo do preço médio ponderado e ajustado baseia-se na observação de uma das duas condições abaixo:

- I. o volume negociado e o número de negócios, na data de referência, foram maiores que o observado em 80% dos dias nos 252 (duzentos e cinquenta e dois) dias úteis precedentes à data de referência; ou
- II. a variação diária do índice, na data de referência, ficou dentro do intervalo de 2 (dois) desvios-padrão da média ponderada por volume da oscilação dos 252 (duzentos e cinquenta e dois) dias úteis precedentes à data de referência.

Se nenhuma das condições acima for observada, repete-se o último preço médio ponderado e ajustado calculado.

Caso contrário, consideram-se todos os preços de CBIOs registrados na data de referência, que estão dentro do intervalo de 2 (dois) desvios-padrão do preço médio ponderado, ponderados pelo volume negociado.

$$PMPA_{d0} = \frac{\sum_{i=1}^N P_i \times Vol_i}{VTR_{d0}}$$

Onde:

$PMPA_{d0}$  = preço médio ponderado e ajustado da data de referência.

$P_i$  = preço observado no registro das operações que estão dentro do intervalo de 2 (dois) desvios-padrão do preço médio ponderado pelo volume, da data de referência.

$Vol_i$  = volume observado no registro das operações que estão dentro do intervalo de 2 (dois) desvios-padrão do preço médio ponderado pelo volume, na data de referência.

$VTR_{d0}$  = volume total registrado de CBIOs, na data de referência.

$N$  = número de operações, na data de referência.

### CÁLCULO DO ÍNDICE CBIO B3

O índice é valorizado diariamente pela variação do preço médio ponderado e ajustado, conforme a seguinte fórmula:

$$ICBIO_{d0} = \frac{PMPA_{d0} * ICBIO_{d-1}}{PMPA_{d-1}}$$

$PMPA_{d0}$  = preço médio ponderado e ajustado da data de referência.

$PMPA_{d-1}$  = preço médio ponderado e ajustado, do dia útil imediatamente anterior a data de referência.

$ICBIO_{d0}$  = índice CBIO B3 da data de referência.

$ICBIO_{d-1}$  = índice CBIO B3 do dia útil imediatamente anterior a data de referência.

### Considerações

**Data de início:** 15/06/2020.

**Valor inicial ou base do índice (quant. de pontos):** 1.000,000000.

**Precisão:** seis casas decimais, com truncamento.



117/2022-PRE

**Forma de valorização:** o índice é valorizado pela variação do preço médio ponderado e ajustado.

**Calendário:** o índice utiliza dados de CBIOs registrados conforme o calendário do Balcão B3, disponível na página:

[https://www.b3.com.br/pt\\_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-participantes-e-traders/calendario-de-negociacao/feriados/](https://www.b3.com.br/pt_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-participantes-e-traders/calendario-de-negociacao/feriados/).