

## **Especificação do arquivo de divulgação.**

O arquivo de preços, volatilidades e retornos são gerados sobe demanda a partir de um arquivo de requisições enviado pelo cliente. O arquivo é gerado em formato csv (facilmente aberto no Excel em Português), de acordo com a descrição abaixo (abra o arquivo exemplo, no Excel, para acompanhar a descrição):

### **Linha 1:**

Campo A1: Fixo com o texto “Version”.

Campo B1: Número da versão do arquivo.

### **Linha 2:**

Campo A2: Fixo com o texto “Reference”.

Campo B2: Campo de data de referência no formato dd/MM/yyyy, onde d = dia, M = mês e y = ano.

### **Linha 3:**

Campo A3: Fixo com o texto “Moment”.

Campo B3: Campo contendo a data e a hora que o arquivo foi gerado no formato dd/MM/yyyy hh:mm, onde d = dia, M = mês, y = ano, h = hora e m = minuto.

### **Linha 4:**

Campo A4: Fixo com o texto “Type”.

Campo B4 e campos subsequentes que estejam preenchidos: Representam o tipo de instrumento financeiro. Atualmente, existem 4 tipos:

- Eq para designar ações,
- Di para designar futuros DI1,
- TitPub para designar títulos públicos,
- Curr para designar moedas.

### **Linha 5:**

Campo A5: Fixo com o texto “Code”.

Campo B5 e campos subsequentes que estejam preenchidos: representam os códigos enviados pelo cliente.

### **Linha 6:**

Campo A6: Fixo com o texto “Maturity”.

Campo B6 e campos subsequentes: Para cada código preenchido na linha 5, caso tenha um prazo ou uma data de vencimento serão preenchidos com este prazo ou esta data de vencimento. Caso contrário ficará vazio.

**Linha 7:**

Campo A7: Fixo com o texto “Status”.

Campo B7 e campos subsequentes: Para cada código preenchido na linha 7 é preenchido com uma mensagem de aviso ou alerta caso ocorra uma oscilação de retorno, preço ou volatilidade maior que o gatilho definido pelo cliente.

**Linha 8:**

Campo A8: Fixo com o texto “InternalName”.

Campo B8 e campos subsequentes: representam os códigos cadastrados internamente na aplicação da Elekto.

**Linha 9:**

Campo A9: Fixo com o texto “Last”.

Campo B9 e campos subsequentes: representa o último preço divulgado para cada instrumento financeiro requisitado, na data de referência solicitada na linha 2.

**Linha 10:**

Campo A10: Fixo com o texto “Previous”.

Campo B10 e campos subsequentes: representa o penúltimo preço divulgado para cada instrumento financeiro requisitado, em relação a data de referência solicitada na linha 2.

**Linha 11:**

Campo A11: Fixo com o texto “LastVolatility”

Campo B11 e campos subsequentes: representa a volatilidade diária divulgado para cada instrumento financeiro requisitado, na data de referência solicitada na linha 2. Quanto à volatilidade calculada:

- Não se encontra anualizada, ou seja, não está multiplicada por  $\sqrt{252/Horizontalidade\ de\ tempo}$ ,
- É utilizado EWMA, com tamanho de 252 dias úteis e lambda de 0,94.

**Linha 12:**

Campo A12: Fixo com o texto “AverageVolatility”

Campo B12 e campos subsequentes: representa a volatilidade média diária divulgado para cada instrumento financeiro requisitado, na data de referência solicitada na linha 2. Quanto à média da volatilidade calculada:

- Não se encontra anualizada, ou seja, não está multiplicada por  $\sqrt{252/Horizontalidade\ de\ tempo}$ ,
- É utilizado EWMA, com tamanho de 252 dias úteis e lambda de 0,94.
- É usada a média dos últimos 21 dias úteis.

**Linha 13 em diante:**

Campo A: datas para o passado em relação a data de referência, preenchidas no formato dd/MM/yyyy, onde d = dia, M = mês e y = ano.

Campo B e subsequentes: mostram os retornos diários de cada ativo para as datas indicadas. Os retornos são calculados como  $retorno_t = \ln(preço_t/preços_{t-1})$ .