

COMUNICADO DE IMPRENSA

S&P Dow Jones Indices e B3 lançam o primeiro índice de volatilidade implícita para o mercado doméstico brasileiro com base na metodologia do índice VIX da Cboe

NOVA YORK, 19 de março de 2024: A S&P Dow Jones Indices (S&P DJI), o principal provedor de índices do mundo, e a B3, a bolsa do Brasil, anunciaram hoje o lançamento de um novo índice de volatilidade implícita, o primeiro a acompanhar o mercado doméstico do Brasil, com base na metodologia do Cboe Volatility Index (índice VIX[®]), propriedade da Cboe Global Markets.

Criado para medir a volatilidade de curto prazo implícita nos preços das opções do Ibovespa B3, o índice S&P/B3 Ibovespa VIX oferece uma visão transparente e eficiente de 30 dias das expectativas da volatilidade no mercado brasileiro.

Esse novo benchmark brasileiro busca oferecer aos participantes do mercado uma melhor compreensão da magnitude dos possíveis movimentos no mercado brasileiro de valores e uma ideia de como esses movimentos podem afetar seus portfólios.

“A S&P Dow Jones Indices tem o prazer de colaborar com a B3 nesse importante lançamento, que expande ainda mais o uso de instrumentos de referência baseados em volatilidade, não apenas nos EUA, mas em mercados fundamentais de todo o mundo”, disse Tim Brennan, diretor de Mercados de Capital da S&P Dow Jones Indices. “A introdução de índices de volatilidade implícita, como o índice S&P/B3 Ibovespa VIX, reflete o ecossistema líquido de produtos no Brasil e complementa a oferta de índices líderes do mercado da S&P DJI”.

“O novo índice acrescenta ao portfólio de produtos da B3 um indicador de volatilidade que pode ser usado por investidores como referência para medir a percepção do risco. O mercado de opções no Brasil atingiu um novo patamar em termos de volume de negociações, o que permitiu o lançamento desse índice e possibilitou trazer para o mercado local uma metodologia que já é consolidada em outras partes do mundo”, afirmou Henio Scheidt, gerente de Índices da B3.

A S&P DJI e a Cboe licenciaram o uso da metodologia do índice VIX para várias bolsas de valores e empresas de índices em todo o mundo. Dessa forma, o índice S&P/B3 Ibovespa VIX amplia ainda mais a linha de indicadores de volatilidade implícita da S&P DJI, que medem o sentimento dos investidores e a volatilidade do mercado em todo o mundo.

“A Cboe tem o prazer de trabalhar com a S&P DJI e a B3 para fornecer o licenciamento da metodologia do nosso índice VIX a ser usada em novos mercados”, disse Catherine Clay, diretora de Derivativos Globais da Cboe Global Markets. “O lançamento do novo índice da B3 não somente ressalta a utilidade universal e a inovação do índice VIX como benchmark para a volatilidade do mercado acionário, mas também marca uma etapa significativa no aprimoramento do ecossistema financeiro em todas as regiões do mundo. O lançamento do novo índice reflete o reconhecimento da comunidade financeira global do papel importante que o índice VIX tem no fornecimento aos participantes do mercado de um indicador claro e mensurável da volatilidade prevista”.

O índice VIX da Cboe é um cálculo projetado para produzir uma medida da volatilidade constante prevista para 30 dias do mercado de valores americano, com base nos preços médios em tempo real das opções de compra e venda do índice S&P 500® (SPXSM). Desenvolvido com base na metodologia do índice VIX, o índice S&P/B3 Ibovespa VIX também utiliza preços de opções em vez de preços de ações em seu cálculo, pois os preços das opções refletem as expectativas dos compradores e vendedores sobre a volatilidade do Ibovespa B3. Embora o índice S&P/B3 Ibovespa VIX não seja um produto negociável, o índice de referência tem como objetivo fornecer visibilidade do sentimento do mercado, o que pode ajudar os participantes do mercado a entender o nível de risco percebido e uma visão de 30 dias do possível espectro de retornos do Ibovespa B3.

Para mais informações sobre a S&P Dow Jones Indices, visite <https://www.spglobal.com/spdji/pt/>.

SOBRE A S&P DOW JONES INDICES

A S&P Dow Jones Indices é a maior fonte global de conceitos, pesquisa e dados essenciais com base em índices. Aqui nasceram indicadores do mercado icônicos como o S&P 500® e o Dow Jones Industrial Average®. Os investimentos de ativos em produtos baseados nos nossos índices são maiores do que qualquer outro provedor no mundo. Desde que Charles Dow criou o primeiro índice em 1884, a S&P DJI tem trabalhado na inovação e desenvolvimento de índices em diversas classes de ativos, ajudando a definir a maneira em que os investidores medem os mercados e fazem negócios.

S&P Dow Jones Indices é uma subsidiária de S&P Global (NYSE: SPGI), que proporciona as informações fundamentais que indivíduos, empresas e governos precisam para tomar decisões com confiança. Para mais informações, visite <https://www.spglobal.com/spdji/pt/>.

SOBRE A B3

A B3 S.A. (B3SA3) é uma das principais empresas de infraestrutura de mercado financeiro do mundo e uma das maiores em valor de mercado, entre as líderes globais do setor de bolsas. Conecta, desenvolve e viabiliza o mercado financeiro e de capitais e, junto com os clientes e a sociedade, potencializa o crescimento do Brasil.

Atua nos ambientes de bolsa e de balcão, além de oferecer produtos e serviços para a cadeia de financiamento. Com sede em São Paulo e escritórios em Chicago, Londres, Singapura e Xangai, desempenha funções importantes no mercado pela promoção de melhores práticas em governança corporativa, gestão de riscos e sustentabilidade.

VIX® e Cboe® são marcas comerciais registradas da Cboe Exchange, Inc. ("Cboe") e foram licenciadas para seu uso pela S&P Dow Jones Indices.

A metodologia do VIX é de propriedade da Cboe, e a Cboe concedeu à S&P Dow Jones Indices uma licença para usar a metodologia do VIX a fim de criar o índice S&P/B3 Ibovespa VIX e concordou que a S&P Dow Jones Indices pode permitir que os valores do índice S&P/B3 Ibovespa VIX sejam divulgados. A Cboe não faz nenhuma declaração com relação ao S&P/B3 Ibovespa VIX ou à conveniência de se confiar em tal índice para qualquer finalidade, e a Cboe não patrocina, endossa, vende ou promove nenhum produto de investimento que seja ou possa ser baseado em tal índice.

Ibovespa, Ibovespa B3, e B3 são marcas comerciais da B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

PARA MAIS INFORMAÇÕES:

S&P Dow Jones Indices

Alyssa Augustyn

Comunicações, América

(+1) 773 919 4732

alyssa.augustyn@spglobal.com

B3

+55 11 2565 7639

imprensa@b3.com.br