



COLETIVA DE MERCADO DE CAPITAIS

1º semestre de 2023



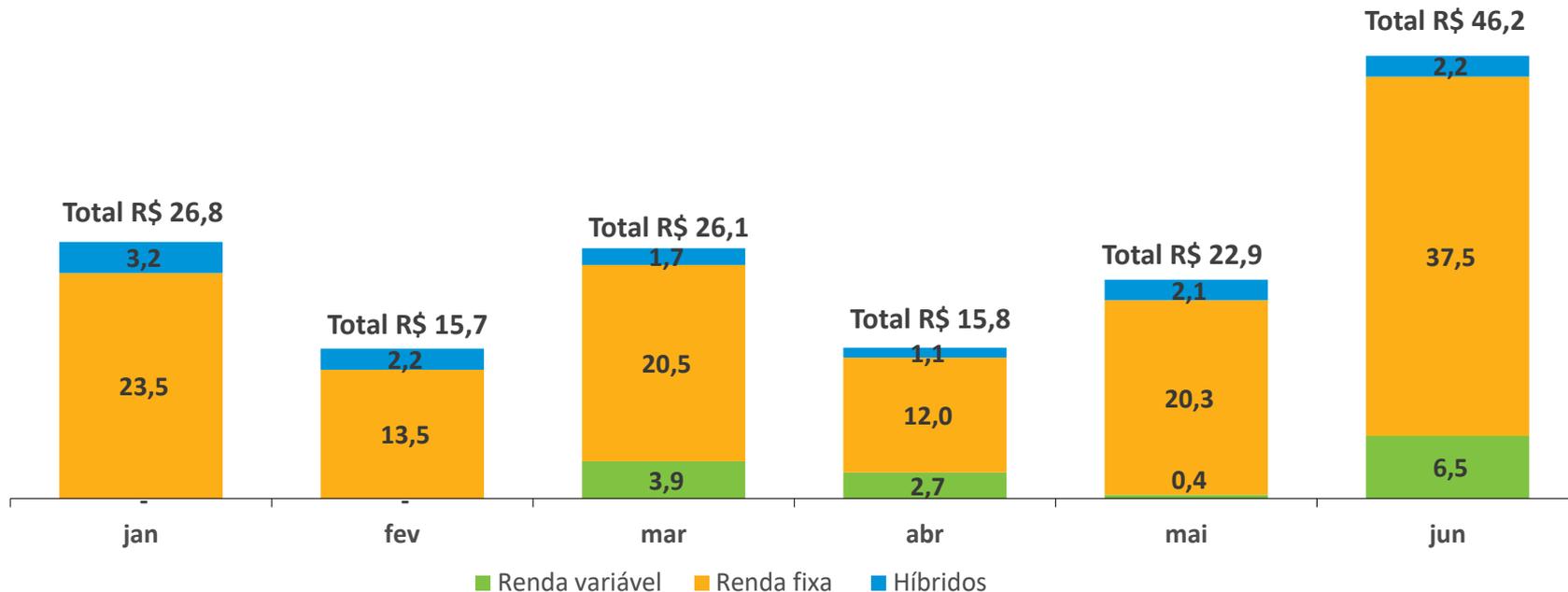
ANBIMA

MERCADO DE CAPITAIS DOMÉSTICO

Ofertas somam R\$ 46,2 bilhões em junho, maior valor mensal do 1º semestre



Total de captação: mercado doméstico renda fixa, híbridos e renda variável
Volume (R\$ bilhões)



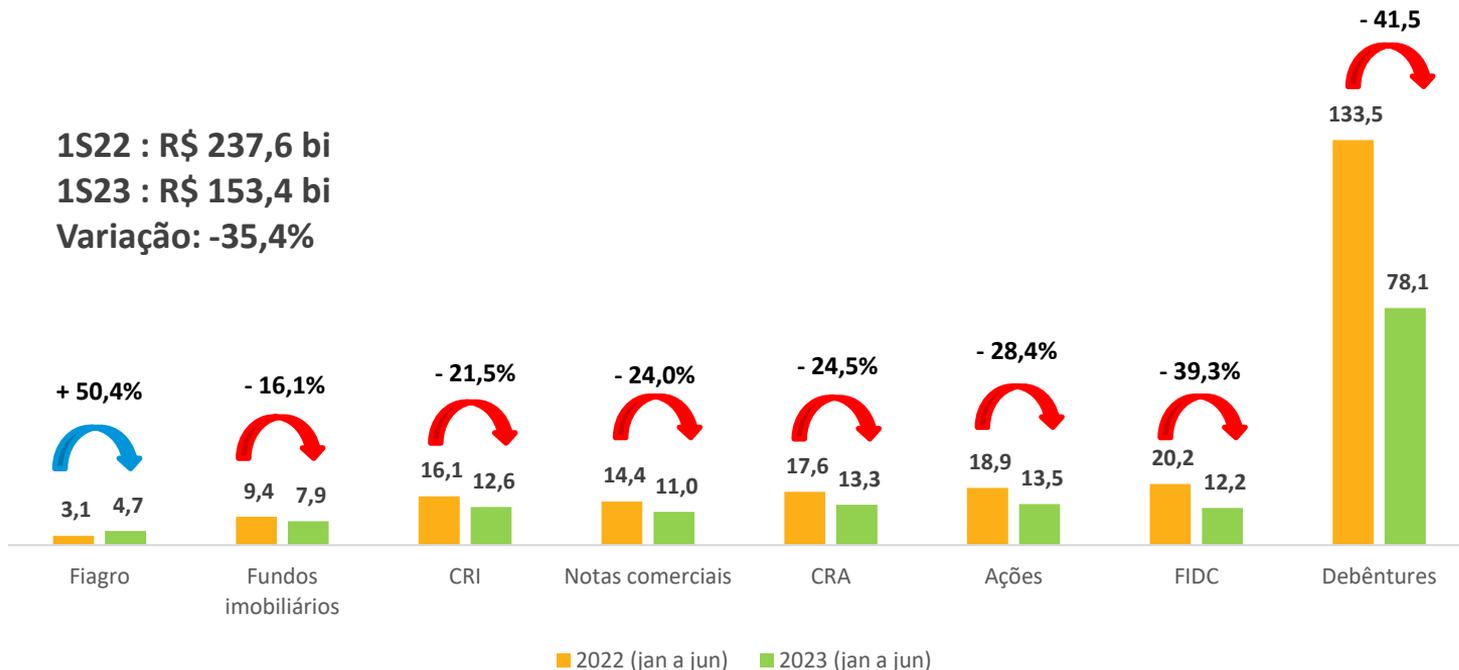
MERCADO DE CAPITAIS DOMÉSTICO

Fiagro se destaca no 1º semestre, com aumento de 50,4% ante o mesmo período em 2022



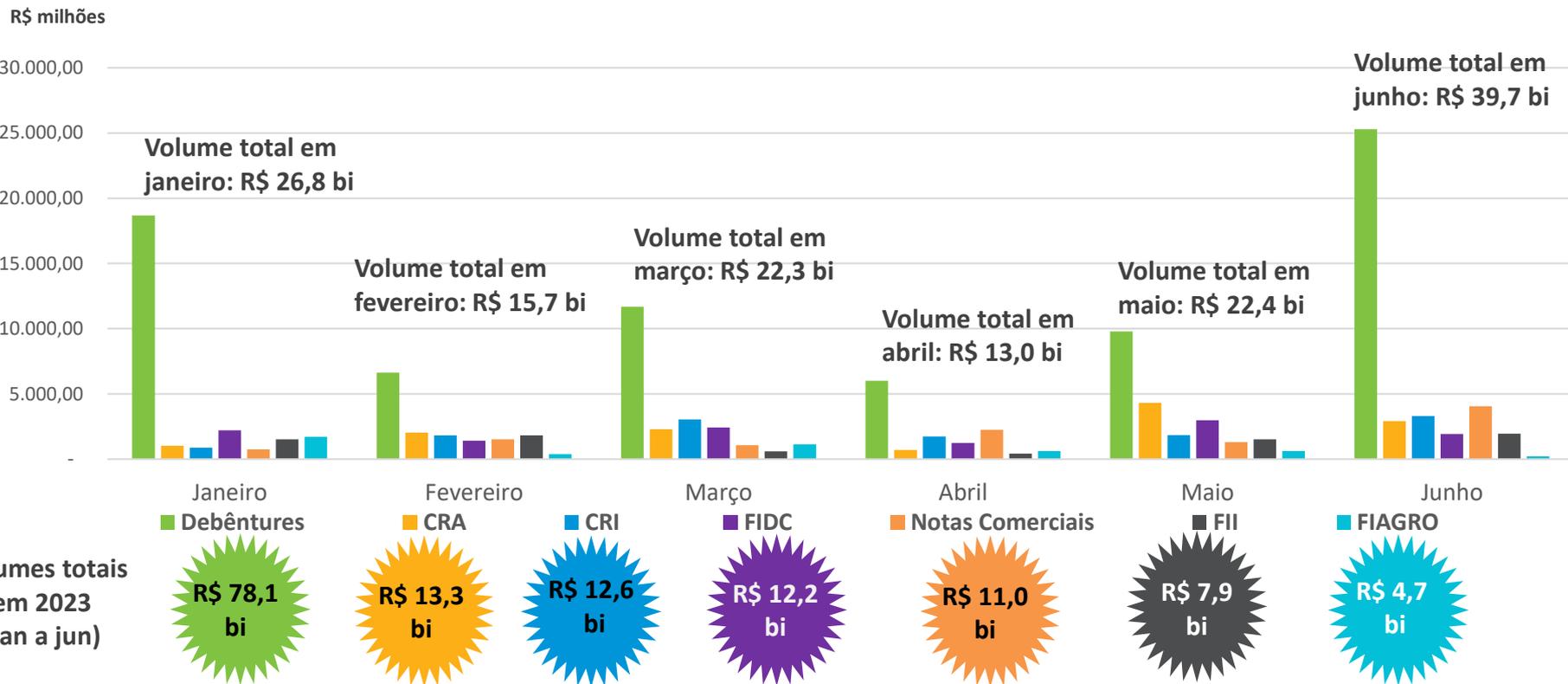
Resultados em R\$ bilhões

1S22 : R\$ 237,6 bi
1S23 : R\$ 153,4 bi
Variação: -35,4%



RENDA FIXA E HÍBRIDOS

Debêntures lideram captações em junho e no primeiro semestre

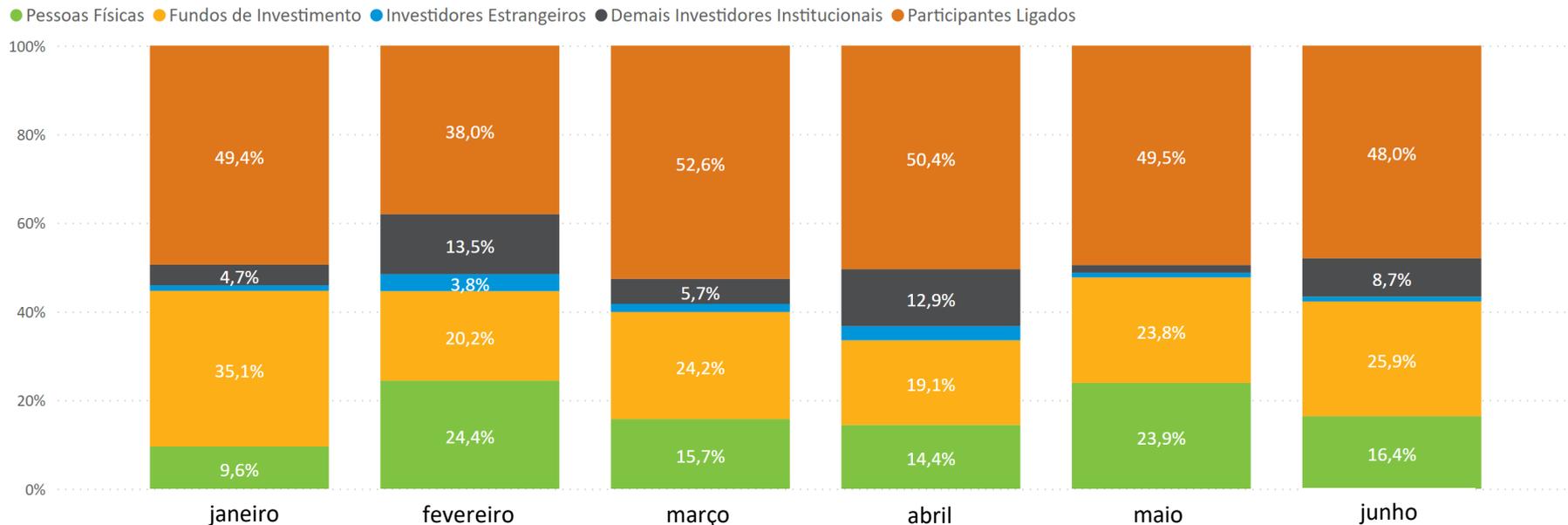


RENDA FIXA E HÍBRIDOS

Players ligados às ofertas têm a maior participação e percentual das pessoas físicas se destaca

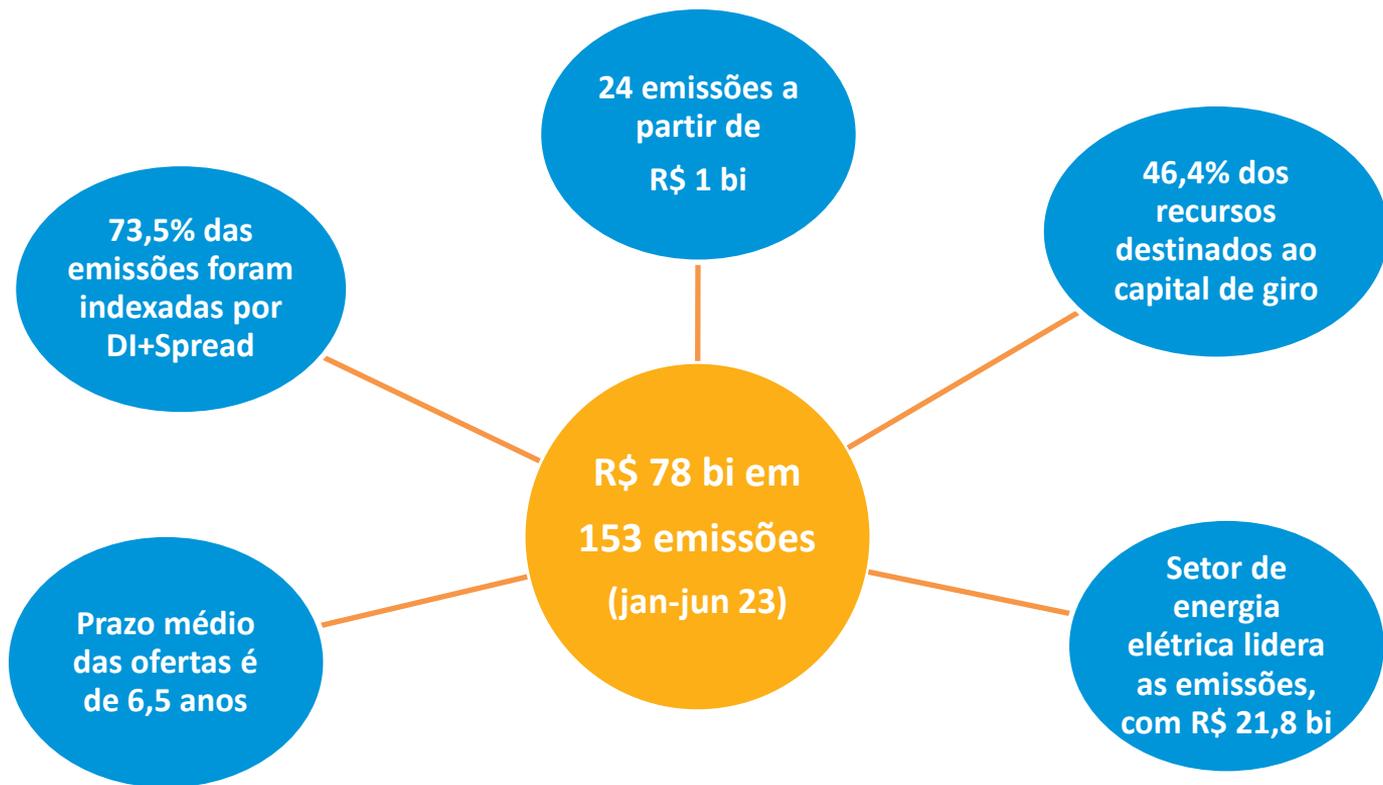


Subscritores das Ofertas Públicas dos Produtos de Renda Fixa e Híbridos (% Volume)



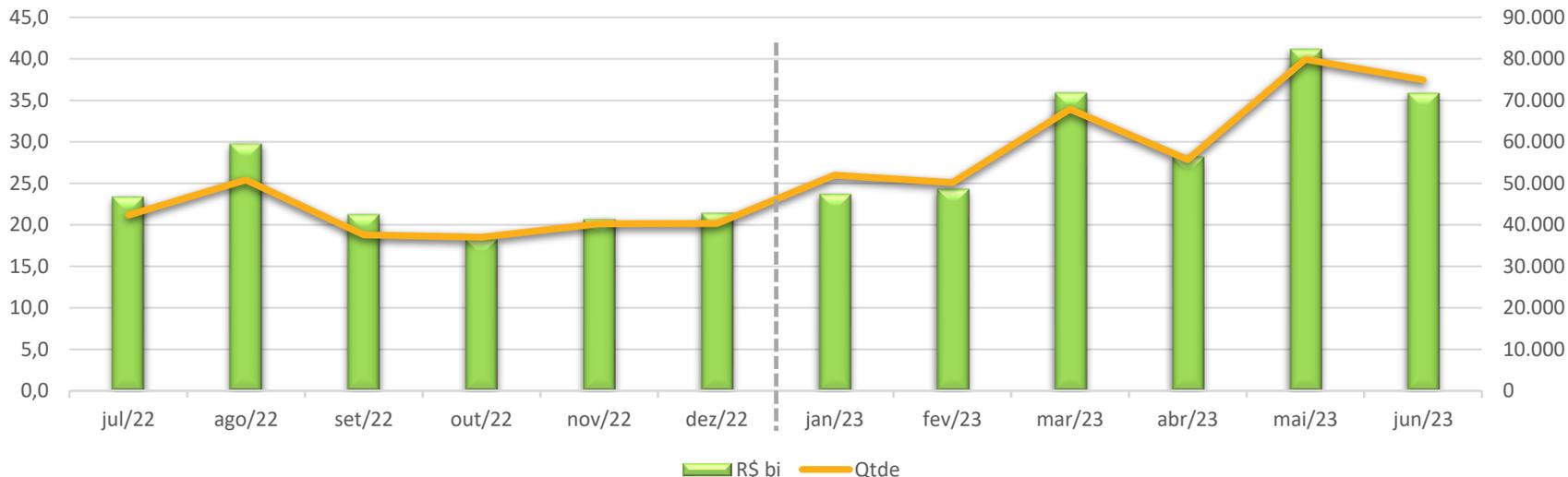
RENDA FIXA DOMÉSTICO – DEBÊNTURES

Prazo médio passou de 6,1 anos no 1º semestre de 2022 para 6,5 anos



RENDA FIXA DOMÉSTICO – DEBÊNTURES

Volume negociado no mercado secundário salta 34,5% em relação ao mesmo período de 2022



+ 34,5% do volume

1S22 : R\$ 140,6 bi

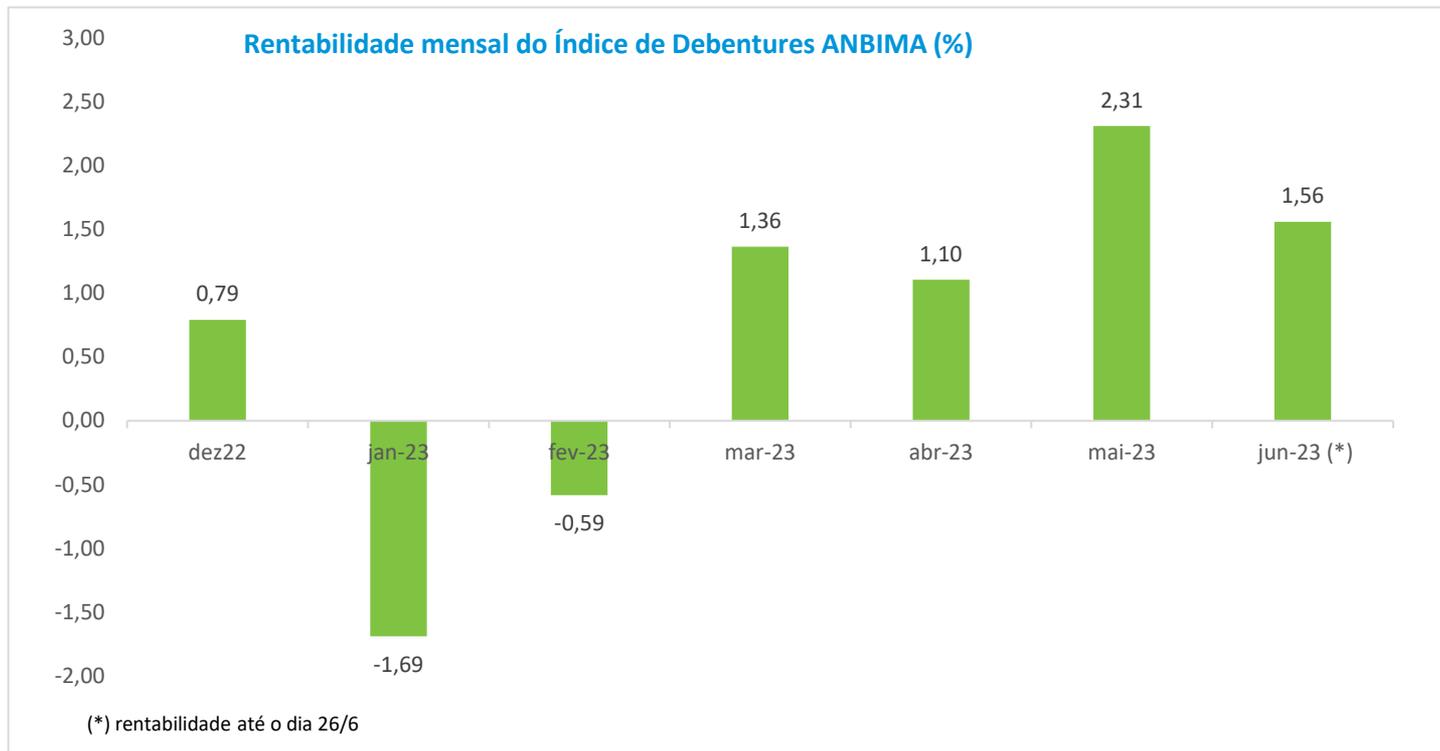
1S23 : R\$ 189,1 bi

Número de negociações aumentou 39,8%
(272,2 mi para 380,5 mi)

¹ Considera apenas negociações extra-grupo. | Fontes: B3 e ANBIMA.

RENDA FIXA DOMÉSTICO – DEBÊNTURES

O IDA Geral, que reflete a carteira das debêntures, avançou 4,46% no acumulado do ano

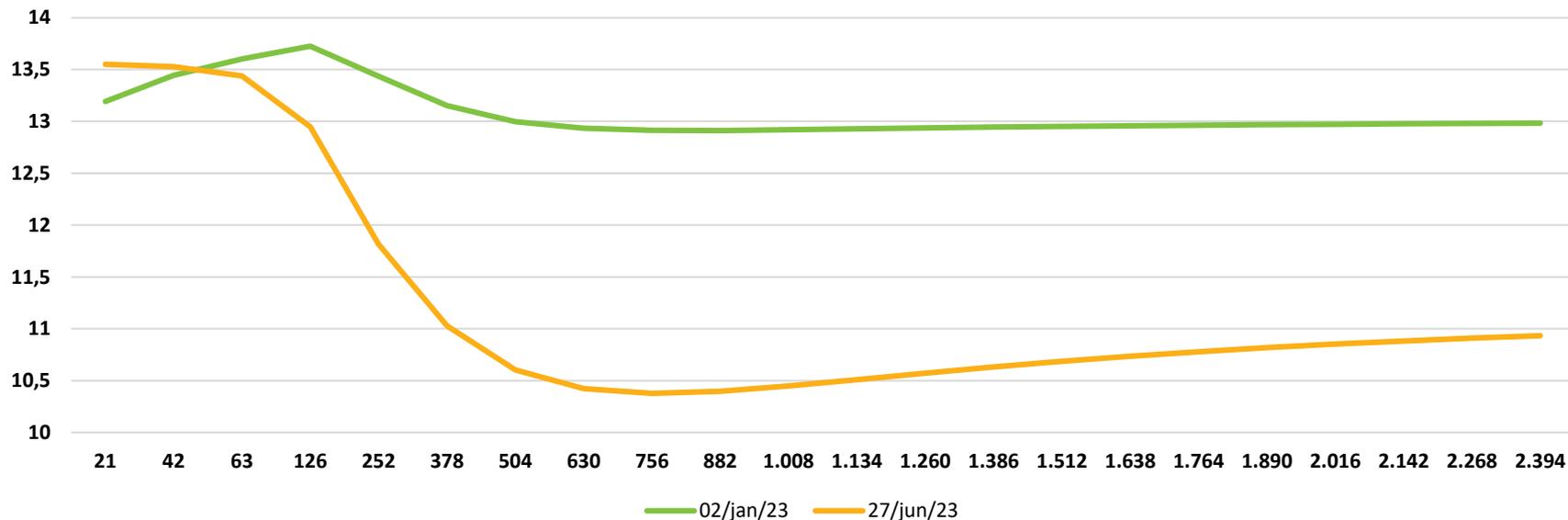


RENDA FIXA DOMÉSTICO – DEBÊNTURES

Juros de longo prazo têm redução de patamar, tornando ambiente mais favorável para emissões



Vértices da Estrutura a Termo Prefixada

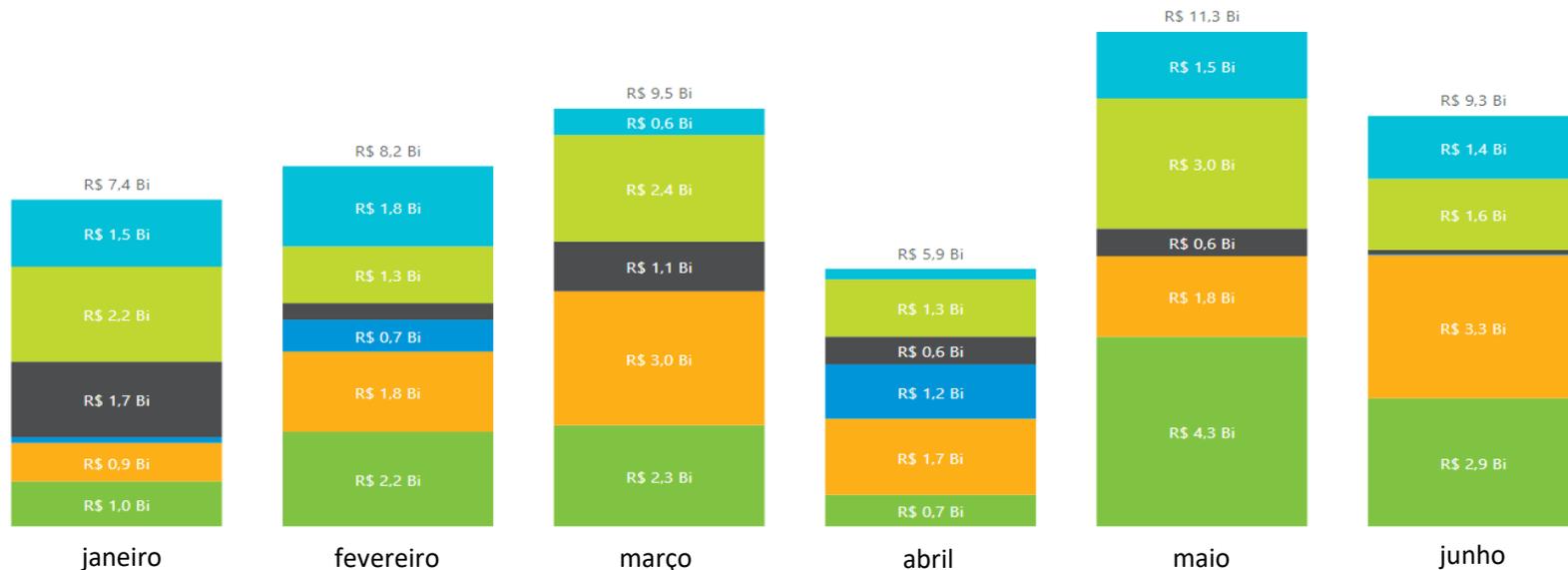


RENDA FIXA – SECURITIZAÇÃO E HÍBRIDOS

Instrumentos registraram em junho o terceiro maior volume mensal do 1º semestre

Volume de Ofertas Públicas (R\$)

● CRA ● CRI ● DEB Securitização ● FIAGRO ● FIDC ● FII ● CR



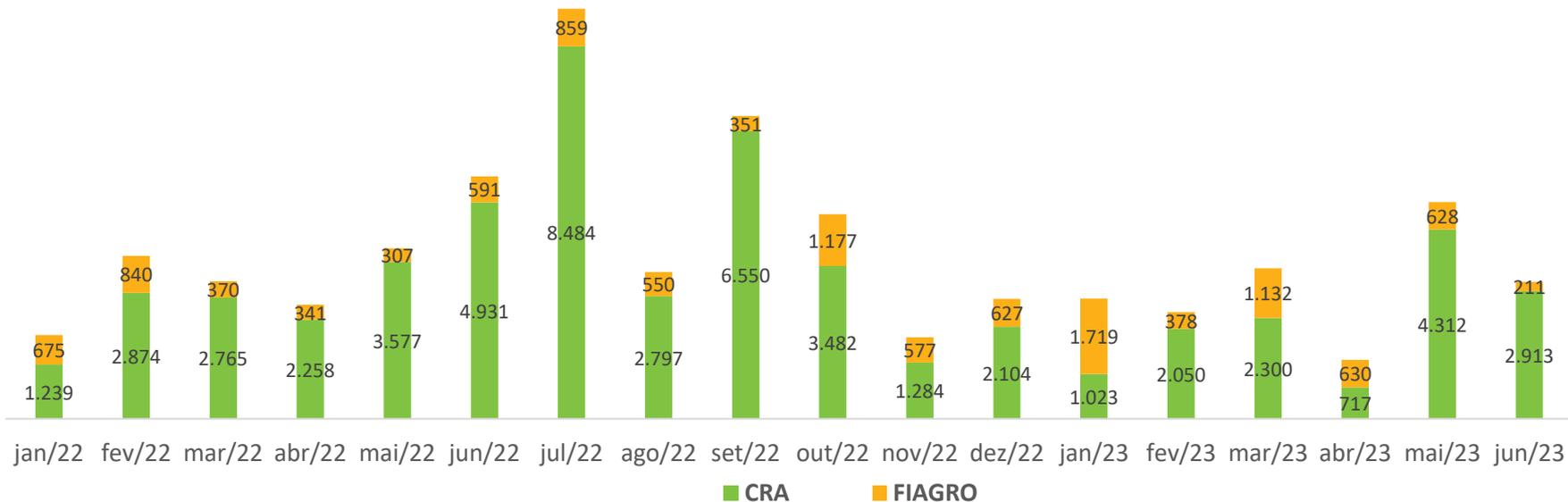
1 oferta de CR encerrada em junho no valor de R\$ 9 milhões

SECURITIZAÇÃO – CRA E FIAGRO

Instrumentos ligados ao agronegócio captaram R\$ 18 bilhões no 1º semestre de 2023



Resultado em R\$ milhões



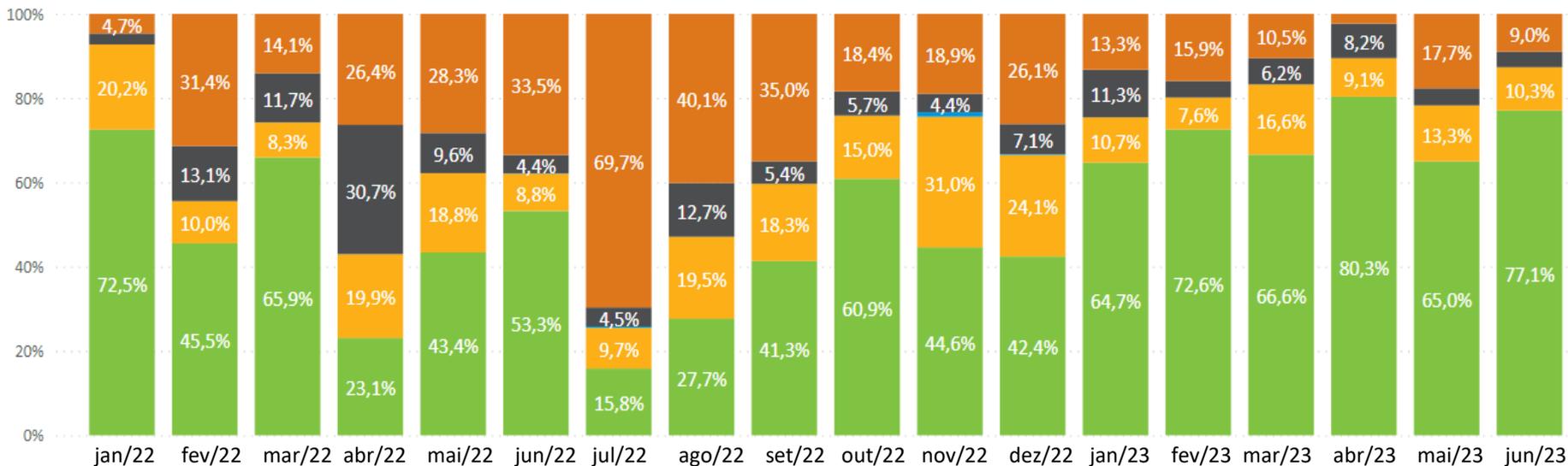
SECURITIZAÇÃO – CRA E FIAGRO

Pessoas físicas ficam com mais de 60% das ofertas ligadas ao agronegócio no 1º semestre



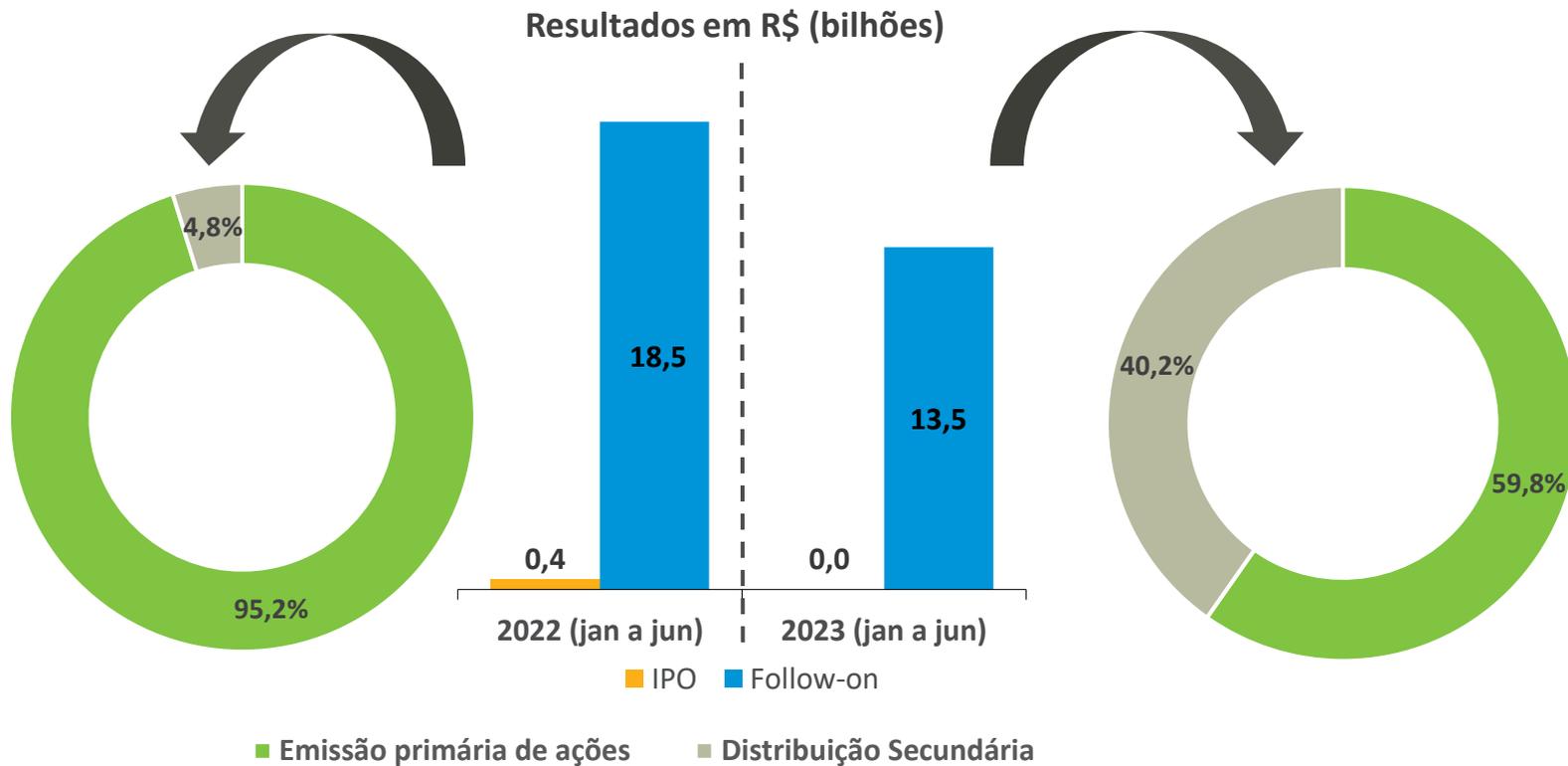
Subscritores das Ofertas Públicas dos Produtos de Renda Fixa e Híbridos (% Volume)

● Pessoas Físicas ● Fundos de Investimento ● Investidores Estrangeiros ● Demais Investidores Institucionais ● Participantes Ligados



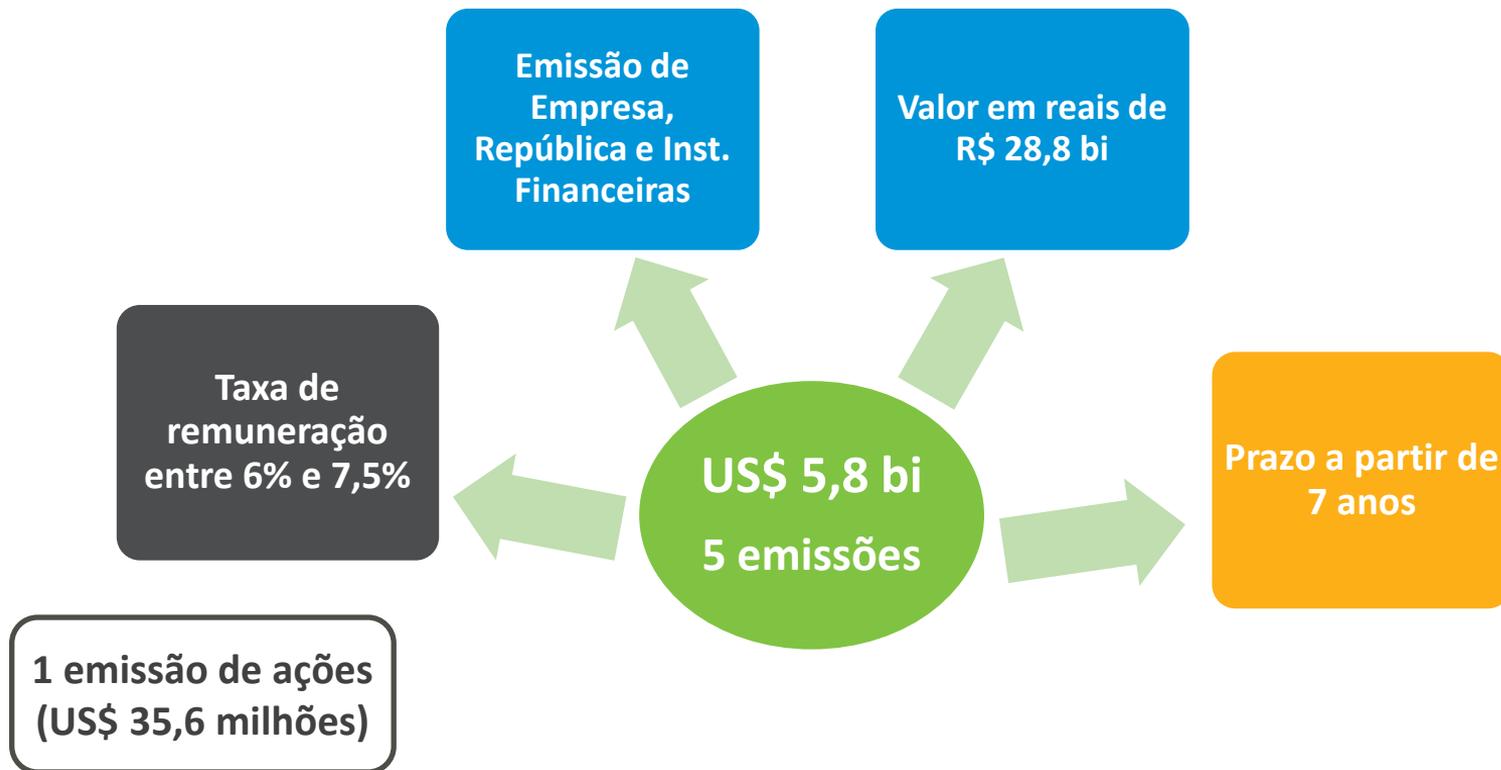
RENDA VARIÁVEL

Foram realizados 8 follow-ons em 2023, contra 13 no mesmo período do ano passado



MERCADO DE CAPITAIS EXTERNO

Emissão da República representa 39% do volume total de bonds



NOVA NORMA DE OFERTAS PÚBLICAS

Ações de disseminação das regras com o objetivo de garantir a adequada implementação pelos players

Assegurar o adequado funcionamento do mercado, considerando a entrada de novos coordenadores de ofertas públicas

Registro de coordenadores (RCVM 161): recebemos 76 pedidos, dos quais 10 já foram aprovados pela CVM

Revisão das regras de autorregulação para alinhamento à norma

GUIA ESG PARA OFERTAS PÚBLICAS DE RENDA FIXA

Fomentar crescimento do mercado de ativos ESG por meio da adesão do guia de orientações publicado em 2022



ANEXO



ANBIMA

MERCADO DE CAPITAIS DOMÉSTICO

Ofertas somam R\$ 153,4 bilhões no 1º semestre, com redução de 35,4% ante igual período de 2022



Resultados em R\$ bilhões

| Mês | 2022 | 2023 | Variação(%) |
|--------------|--------------|--------------|----------------|
| Janeiro | 18,3 | 26,8 | + 46,65% |
| Fevereiro | 48,6 | 15,7 | - 67,80% |
| Março | 39,8 | 26,1 | - 34,37% |
| Abril | 32,0 | 15,8 | - 50,71% |
| Maiο | 44,7 | 22,9 | - 48,91% |
| Junho | 54,1 | 46,2 | - 14,57% |
| TOTAL | 237,6 | 153,4 | -35,42% |

MERCADO DE CAPITAIS DOMÉSTICO

Ofertas somam R\$ 46,2 bilhões em junho, com redução de 14,6% ante igual período de 2022



Resultados em R\$ bilhões

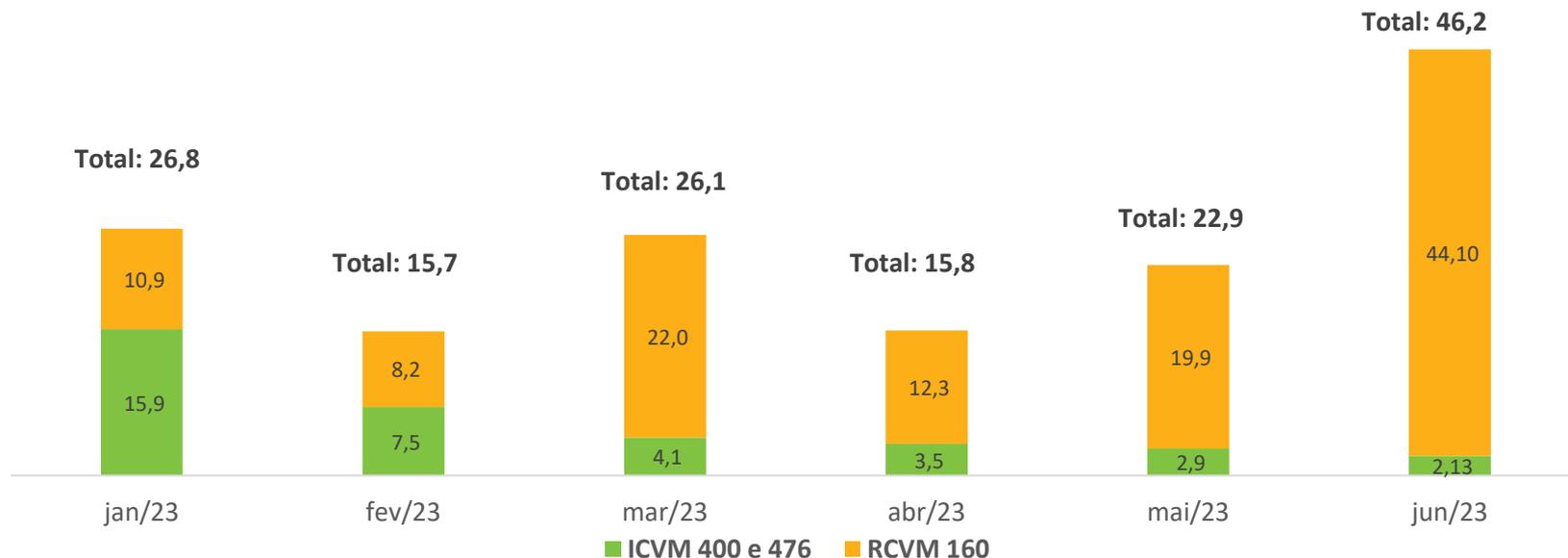
| Instrumento | jun/22 | jun/23 | Variação(%) |
|---------------------|-------------|-------------|----------------|
| Notas comerciais | 2,5 | 4,1 | 65,66% |
| Ações | 5,6 | 6,5 | 16,00% |
| Debêntures | 28,4 | 25,3 | -10,96% |
| Fundos imobiliários | 2,3 | 2,0 | -15,22% |
| CRI | 5,0 | 3,3 | -33,39% |
| FIDC | 3,2 | 1,9 | -39,01% |
| CRA | 4,9 | 2,9 | -40,93% |
| Fiagro | 0,6 | 0,2 | -64,26% |
| Notas promissórias | 1,6 | - | |
| CR | - | 0,0 | |
| TOTAL | 54,1 | 46,2 | -14,59% |

MERCADO DE CAPITAIS DOMÉSTICO – NOVA NORMA DE OFERTAS

Emissões realizadas via Resolução CVM 160 representam 77% do volume encerrado no 1º semestre*



Resultados em R\$ bilhões



*Ofertas via ICVM 400 e 476 em 2023: emissões iniciadas em 2022 e encerradas em 2023.

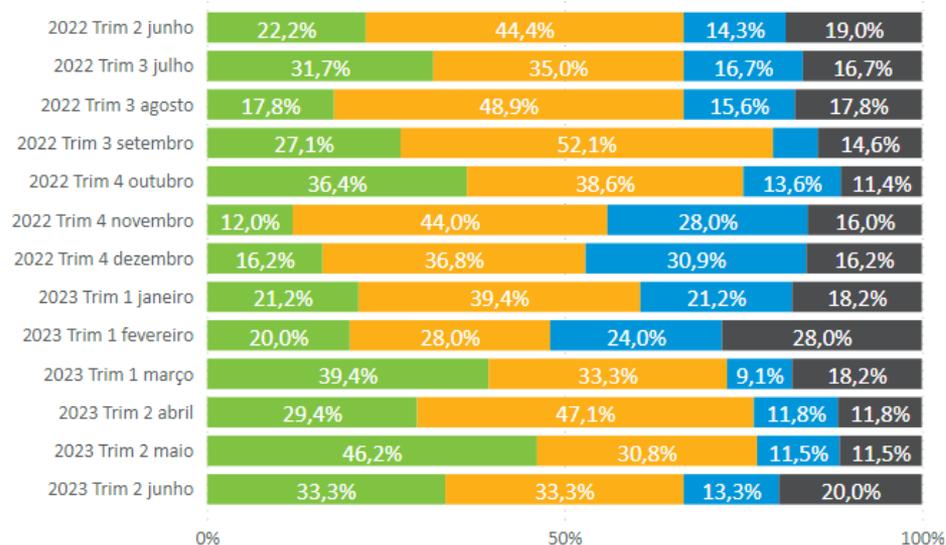
Todas as operações iniciadas em 2023 seguem a Resolução CVM 160

RENDA FIXA DOMÉSTICO – DEBÊNTURES

Houve leve aumento nos prazos de vencimento em junho

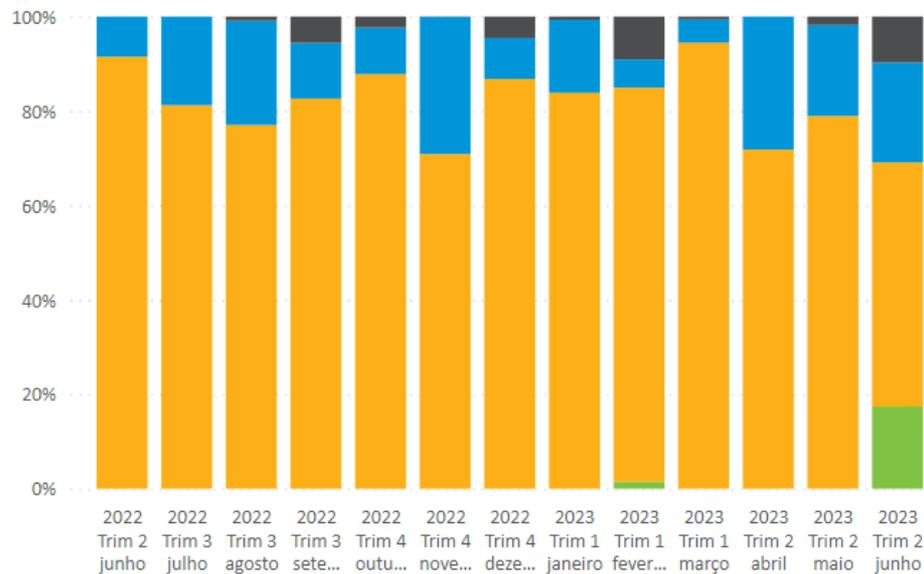
Prazo das Emissões (% Número de séries)

● Até 3 anos ● De 4 a 6 anos ● De 7 a 9 anos ● 10 anos ou mais



Evolução dos Indexadores (% Volume)

● DI ● DI + Spread ● IPCA ● Outros



RENDA FIXA DOMÉSTICO – DEBÊNTURES

Observada queda do spread a partir de maio

Spread Top 10 - carteira junho/23



| ATIVOS |
|--------|
| PEJA11 |
| ENEV29 |
| ITPO14 |
| ENEV19 |
| CCROB6 |
| EGIEA0 |
| JSMLA5 |
| CEAB12 |
| AMBP13 |
| ENEV39 |



José Eduardo Laloni

Vice-presidente da ANBIMA

Flávia Palácios

coordenadora da Comissão
de Securitização

imprensa@anbima.com.br



ANBIMA