

13 de junho de 2023
092/2023-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Revogação Parcial do Ofício Circular 058/2002-DG, sobre Taxas Referenciais de Câmbio e Títulos Públicos**

A B3 informa que revoga os documentos listados abaixo, referentes às metodologias de cálculo de taxas referenciais e preços de títulos públicos, considerando que não estão mais vigentes ou que passarão por mudança em razão da descontinuidade de taxa Libor.

1. Revogação do Anexo II do Ofício Circular 058/2002-DG de 19/04/2002, que já não estava vigente, sobre taxa referencial de DI. Ressaltamos que a apuração da taxa referencial de DI prevista no Anexo II não é mais aplicável. Assim sendo, não há nenhuma alteração na metodologia em vigor do cálculo de taxa referencial de DI. A metodologia vigente para apuração da taxa DI está disponível em www.b3.com.br, Market Data e Índices, Índices, Índices de Segmentos e Setoriais, Índice DI B3, Metodologia de Cálculo do DI.
2. Revogação do Anexo IV do Ofício Circular 058/2002-DG de 19/04/2002, que já não estava vigente, sobre preço de títulos públicos. Ressaltamos que a metodologia de coleta e apuração de taxas de títulos públicos prevista no

Anexo IV não é mais aplicável. Assim sendo, não há nenhuma alteração na metodologia em vigor do cálculo dos preços de títulos públicos.

A metodologia vigente para apuração dos títulos públicos está disponível em www.b3.com.br, Market Data e Índices, Market Data, Consultas, Metodologia, Metodologia de apreçamento de Títulos Públicos.

3. Revogação, a partir de 03/07/2023, do Anexo III do Ofício Circular 058/2002-DG de 19/04/2002 sobre taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos. Ressaltamos que não há qualquer alteração na metodologia de coleta de dados com as instituições financeiras em vigor. Também não há alteração nas fórmulas de cálculo das taxas referencias de câmbio em vigor.

Contudo, haverá alteração em um dos insumos da fórmula de cálculo da taxa de câmbio para liquidação de um dia. Mais especificamente, em razão da descontinuação da divulgação da taxa Libor, o cálculo da taxa referencial de um dia passará a usar, no lugar da taxa Libor, a taxa SOFR (taxa Secured Overnight Financing Rate) divulgada pelo Federal Reserve Bank de Nova York. A metodologia para apuração da taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos está disponível em www.b3.com.br, Market Data e Índices, Market Data, Consultas, Metodologia, Metodologia do indicador da taxa de câmbio de dólar referencial. A taxa referencial de câmbio para liquidação em um dia continua sendo a taxa utilizada para:

- a liquidação financeira em reais dos ajustes diários, das operações de day trade e da liquidação no vencimento dos contratos futuros negociados em dólares de Estados Unidos, conforme descrito nos respectivos contratos;
- a liquidação financeira em reais dos prêmios, das operações de day trade e da liquidação no vencimento dos contratos de opções negociadas em dólares de Estados Unidos, conforme descrito nos respectivos contratos;

092/2023-PRE

- como insumo para o cálculo do valor do repasse financeiro de variação cambial para investidores não residentes, nos termos da Resolução CMN 2687, conforme descrito no Ofício Circular 097/2022-PRE.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Gerência de Preços e Taxas de Referência, pelo telefone (11) 2565-5033 ou e-mail gp-tr-pricing@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

Mario Palhares
Vice-Presidente de Operações –
Negociação Eletrônica e CCP