

22 de novembro de 2022
160/2022-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Alteração no Modelo de Apreçamento do Contrato Futuro de DI**

Informamos que, a partir de **12/12/2022**, inclusive, o preço de ajuste do Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (Futuro de DI) será calculado por meio de uma metodologia de média ponderada por volume (VWAP). A janela utilizada para o cálculo do preço será das 16h10 às 16h20.

A metodologia completa poderá ser consultada no Manual de Apreçamento da B3, disponível em www.b3.com.br, Market Data e Índices, Serviços de Dados, Market Data, Consultas, Mercado de Derivativos, Metodologia, Manual de Apreçamento da B3 – Futuros.

Em virtude do novo modelo de apreçamento, será descontinuado o procedimento de call eletrônico de fechamento para apuração dos preços de ajuste.

Quanto aos horários de negociação para o contrato Futuro de DI, serão alterados a partir de **12/12/2022**, conforme Anexo deste Ofício Circular.



160/2022-PRE

Os horários de negociação estão disponíveis em www.b3.com.br, Soluções, Plataformas, PUMA Trading System, Participantes e traders, Horário de negociação, Derivativos, Taxas de juros.

Mais informações sobre o projeto podem ser consultas em https://clientes.b3.com.br/pt_br, Roadmap, Futuro de DI: Aprimoramento do modelo de apreçamento e negociação de TAS.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria Executiva de Produtos Listados e Dados, pelos telefones (11) 2565-6324/7119; ou com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelo telefone (11) 2565-5022 ou pelo e-mail negociacao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes



Anexo I do OFÍCIO CIRCULAR 160/2022- PRE

Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia

Contrato	Negociação Normal		Cancelamento de Ofertas		Call Eletrônico	Cancelamento de Ofertas		Negociação Estendida (D+0)		Negociação after-hours (D+1)	
	Início	Fim	Início	Fim	início	Início	Fim	início	Fim	início	Fim
Futuro de DI1	9:00 ¹	18:00	-	-	-	-	-	-	-	-	-

¹ A fase de pré-abertura terá início 5 minutos antes do início da fase de negociação.