

30 de agosto de 2022  
110/2022-PRE

## OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Inclusão de novo principal fator de risco para a estratégia de encerramento do tipo otimizado no modelo de cálculo de risco da Câmara B3**

Informamos que, a partir de **05/09/2022**, inclusive, a B3 ampliará a relação dos principais fatores de risco aos quais é aplicada a estratégia de encerramento do tipo otimizado no modelo de cálculo de risco da Câmara B3, disposta no Ofício Circular 098/2022-PRE, passando a incluir o principal fator de risco associado à taxa de juros pré-fixada em reais.

Após a inclusão deste novo principal fator de risco, a estratégia de encerramento do tipo otimizado passará a ser aplicada, para fins do cálculo de risco da Câmara B3, em dois conjuntos de instrumentos de forma independente: (i) um conjunto de contratos e instrumentos cujo principal fator de risco é a taxa de câmbio entre Dólar dos EUA e Real (Dólar à vista) e; (ii) um conjunto de contratos e instrumentos cujo principal fator de risco é a taxa de juros pré-fixada em reais.

Passam a ser elegíveis à utilização da estratégia de encerramento do tipo otimizado, cujo principal fator de risco é a taxa de juros pré-fixada em reais, todos os contratos futuros de taxa média de depósitos interfinanceiros de um dia (DI1).

A lista de instrumentos selecionados e os parâmetros utilizados na estratégia de encerramento do tipo otimizado estão disponíveis em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Produtos e Serviços, Compensação e Liquidação, Clearing, Administração de Riscos, Risco Intradiário, Parâmetros do Modelo de Risco.

As definições sobre o modelo de encerramento do tipo otimizado estão disponíveis no Manual de Administração de Risco da Câmara B3, em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Regulação Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Compensação, liquidação e gerenciamento de riscos.

Informações, materiais de apoio e atualizações sobre o projeto de implementação da estratégia de encerramento do tipo otimizado no modelo de cálculo de risco da Câmara B3 estão disponíveis em [https://clientes.b3.com.br/pt\\_br](https://clientes.b3.com.br/pt_br), Roadmap, Projetos, Todos os projetos, Otimização de FPRs Pré.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Administração de Risco, pelos telefones (11) 2565-5031/5032.

Gilson Finkelsztain  
Presidente

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