

28 de novembro de 2017

024/2017-DO

OFÍCIO CIRCULAR

Revogado pelo Ofício Circular nº 034-2018-VOP, de 28 de junho de 2018

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **Contratos Futuros de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (DI1) e de Taxa Média das Operações Compromissadas de Um Dia com Lastro em Títulos Públicos Federais (OC1) – Alteração dos Limites de Oscilação Diária.**

A B3 informa que, a partir de **04/12/2017**, inclusive, entrarão em vigor novos valores de limites de oscilação diária para os Contratos Futuros de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (DI1) e de Taxa Média das Operações Compromissadas de Um Dia com Lastro em Títulos Públicos Federais (OC1).

Os limites de oscilação diária de preço, para os contratos futuros de DI1 e OC1 serão definidos conforme tabela abaixo.

Intervalo	Limite de Oscilação Diária (bps)
Até 1 mês	25
Entre 1 mês a 2 meses	30
Entre 2 a 3 meses	35
Entre 3 a 4 meses	42
Entre 4 a 5 meses	49
Entre 5 a 6 meses	55
Entre 6 a 7 meses	60

024/2017-DO

Intervalo	Limite de Oscilação Diária (bps)
Entre 7 a 8 meses	64
Entre 8 a 9 meses	68
Entre 9 a 10 meses	72
Entre 10 a 11 meses	76
Entre 11 meses a 1 ano	80
Entre 1 ano a 1 ano e 3 meses	85
Entre 1 ano e 3 meses a 1 ano e 6 meses	90
Entre 1 ano e 6 meses a 1 ano e 9 meses	95
Entre 1 ano e 9 meses a 2 anos	100
Entre 2 anos a 2 anos e 3 meses	103
Entre 2 anos e 3 meses a 2 anos e 6 meses	105
Entre 2 anos e 6 meses a 2 anos e 9 meses	108
Entre 2 anos e 9 meses a 3 anos	110
Entre 3 anos a 3 anos e 3 meses	111
Entre 3 anos e 3 meses a 3 anos e 6 meses	112
Entre 3 anos e 6 meses a 3 anos e 9 meses	113
Entre 3 anos e 9 meses a 4 anos	114
Entre 4 anos a 4 anos e 3 meses	115
Entre 4 anos e 3 meses a 4 anos e 6 meses	116
Entre 4 anos e 6 meses a 4 anos e 9 meses	117
Acima de 4 anos e 9 meses	118

O limite de oscilação será determinado com base no preço de ajuste do dia útil anterior de cada vencimento autorizado à negociação (expresso em PU). Considerando-se o preço de ajuste, será apurada a taxa de juro, expressa sob

024/2017-DO

forma efetiva, base 252 dias úteis, com até três casas decimais, denominada taxa de juro de referência.

O enquadramento dos vencimentos dos contratos em referência nas faixas da tabela será atualizado mensalmente, no quinto dia útil anterior ao último dia do mês.

A B3 poderá revogar ou alterar, a qualquer momento, os limites de oscilação descritos neste Ofício Circular, mediante comunicação prévia ao mercado.

Destaca-se que, nas últimas três sessões de negociação anteriores ao vencimento, dos contratos futuros de DI1 e OC1, os limites de oscilação diária dispostos neste Ofício Circular não serão utilizados.

Os parâmetros utilizados no cálculo dos limites de oscilação diária estão disponíveis em www.bmfbovespa.com.br, Regulação, Regulamento e manuais, Operações, Parâmetros, Oscilação Diária de Negociação.

Este Ofício Circular revoga e substitui o Ofício Circular 028/2016-DP, de 11/04/2016.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Operações, pelos telefones (11) 2565-4680 ou pelo e-mail controledeoperacoes@bvmf.com.br.

Atenciosamente,

Cícero Augusto Vieira Neto
Vice-Presidente de Operações,
Clearing e Depositária

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e
Clientes