

2 de junho de 2022
095/2022-VNC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Novos Túneis de Negociação para os Contratos de Opções sobre Ações, ETFs e Índices**

A B3 informa que, a partir do dia **06/06/2022**, inclusive, alterará os parâmetros de cálculo dos túneis de leilão para os contratos de opções sobre ações, ETFs e índices, cujos ativos objetos são classificados como ilíquidos de acordo com a metodologia para os cálculos dos prêmios de referência das opções descrita no Manual de Apreçamento da B3, Contrato de Opções, 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.

1. Choque de volatilidade

Opções de ações, ETFs e índices ilíquidos	Parâmetro atual		Parâmetro novo	
	-	+	-	+
Túnel de leilão	30%	30%	55%	55%

2. Janela de tempo para apuração dos preços mínimo e máximo do ativo objeto

Opções de ações, ETFs e índices ilíquidos	Parâmetro atual	Parâmetro novo
Janela de tempo	90 minutos	60 minutos

As definições sobre leilões e túneis de negociação estão disponíveis no Manual de Procedimentos Operacionais de Negociação e no Regulamento de Negociação da B3, em www.b3.com.br, Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Negociação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte à Negociação pelo telefone (11) 2565-5022 ou e-mail negociacao@b3.com.br.

Mario Palhares

Vice-Presidente de Operações – Negociação Eletrônica e CCP