

28 de junho de 2018

034/2018-VOP

OFÍCIO CIRCULAR

Revogado pelo Ofício Circular nº 156/2021-PRE, de 03 de Dezembro de 2021.

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **Alteração dos Limites de Oscilação Diária – 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).**

A B3 informa que, em **02/07/2018**, 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).

Ressalta-se que, na última sessão de negociação anterior ao vencimento para os contratos DI1 e OC1, os limites de oscilação diária dispostos neste Ofício Circular não serão utilizados.

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 Atual – Máximo e Mínimo – bps	Novo Limite Máximo de Oscilação – bps	Novo Limite Mínimo de Oscilação – bps
Até 1 mês	25	35	35
Entre 1 mês e 2 meses	30	43	43
Entre 2 e 3 meses	35	50	50
Entre 3 e 4 meses	42	57	54

034/2018-VOP

Intervalo	Limite de Oscilação Diária Atual – Máximo e Mínimo – bps	Novo Limite Máximo de Oscilação – bps	Novo Limite Mínimo de Oscilação – bps
Entre 4 e 5 meses	49	64	57
Entre 5 e 6 meses	55	70	60
Entre 6 e 7 meses	60	74	62
Entre 7 e 8 meses	64	78	64
Entre 8 e 9 meses	68	82	65
Entre 9 e 10 meses	72	85	67
Entre 10 e 11 meses	76	89	69
Entre 11 meses e 1 ano	80	93	70
Entre 1 ano e 1 ano e 3 meses	85	97	74
Entre 1 ano e 3 meses e 1 ano e 6 meses	90	102	77
Entre 1 ano e 6 meses e 1 ano e 9 meses	95	106	80
Entre 1 ano e 9 meses e 2 anos	100	110	83
Entre 2 anos e 2 anos e 3 meses	103	112	85
Entre 2 anos e 3 meses e 2 anos e 6 meses	105	114	87
Entre 2 anos e 6 meses e 2 anos e 9 meses	108	116	89
Entre 2 anos e 9 meses e 3 anos	110	118	90
Entre 3 anos e 3 anos e 3 meses	111	119	91
Entre 3 anos e 3 meses e 3 anos e 6 meses	112	119	92
Entre 3 anos e 6 meses e 3 anos e 9 meses	113	120	92
Entre 3 anos e 9 meses e 4 anos	114	120	93
Entre 4 anos e 4 anos e 3 meses	115	121	94
Entre 4 anos e 3 meses e 4 anos e 6 meses	116	122	94
Entre 4 anos e 6 meses e 4 anos e 9 meses	117	122	95

Intervalo	Limite de Oscilação Diária Atual – Máximo e Mínimo – bps	Novo Limite Máximo de Oscilação – bps	Novo Limite Mínimo de Oscilação – bps
Entre 4 anos e 9 meses a 6 anos	118	123	95
Entre 6 anos e 7 anos e 6 meses	118	124	95
Acima de 7 anos e 6 meses	118	125	95

O limite de oscilação será determinado com base no preço de ajuste em taxa do dia útil anterior de cada vencimento autorizado à negociação. O enquadramento dos vencimentos dos contratos futuros de DI1 e OC1 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.

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 024/2017-DO, de 28/11/2017.

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

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

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos
e Clientes