

21 de setembro de 2023  
014/2023-VPC

## OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Disponibilização dos Preços das Legs no Execution Report para Contratos de Rolagem de Futuros de Commodities**

Informamos que, a partir de **09/10/2023**, os contratos de rolagem de futuros de commodities passarão a contar com a disponibilização dos preços dos instrumentos que compõem as legs, via Execution Report, conforme descrito a seguir.

- Operações Estruturadas de Rolagem de Boi Gordo com Liquidação Financeira (BR1)
- Operações Estruturadas de Rolagem de Café Arábica Tipo 4/5 (CR1)
- Operações Estruturadas de Rolagem de Etanol Hidratado com Liquidação Financeira (ET1)
- Operações Estruturadas de Rolagem de Milho com Liquidação Financeira (MR1)
- Operações Estruturadas de Rolagem de Futuro de Soja do CME Group (SC1)
- Operações Estruturadas de Rolagem do Futuro de Soja FOB com Liquidação Financeira Platts (SO1)

Para cada negócio realizado, o participante receberá 3 Execution Reports, sendo 1 Execution Report com a mensagem de execução e o preço negociado da operação estruturada de rolagem (BR1/CR1/ET1/MR1/SC1/SO1) e 2 Execution Report adicionais com a confirmação dos negócios e preços dos instrumentos que compõem as legs (BGI/ICF/ETH/CCM/SJC/SOY).

Não há alteração na estrutura da mensagem de Execution Report, exceto o envio do Execution Report dos instrumentos que compõem as legs, relativo a preço e quantidade, que serão publicados no instante em que a estratégia for negociada.

Além disso, as operações estruturadas de contratos de commodities seguem as características descritas abaixo para estabelecer os preços das legs.

## **1. Operação automática de registro do contrato futuro (ponta curta)**

- a. Natureza da operação:** inversa da operação da estratégia.
- b. Preço:** preço do último negócio da ponta curta realizado no momento do registro da operação, ou o preço de referência calculado pela B3.
- c. Quantidade:** idêntica à quantidade da operação da estratégia.

## **2. Operação automática de registro do contrato futuro (ponta longa)**

- a. Natureza da operação:** idêntica à operação da estratégia.
- b. Preço:** preço da ponta curta + preço negociado da estratégia.
- c. Quantidade:** idêntica à quantidade da operação da estratégia.

014/2023-VPC

As demais especificações de cada contrato permanecem inalteradas.

Este Ofício Circular revoga o Ofício Circular 054/2009-DP de 14/09/2009, referente às Operações Estruturadas de Rolagens dos Contratos Futuros de Boi Gordo e Milho com Liquidação Financeira.

Mais informações sobre o projeto podem ser consultas em [https://clientes.b3.com.br/pt\\_br](https://clientes.b3.com.br/pt_br), Aprimoramentos nas Rolagens de Commodities.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria Produtos Listados, pelo e-mail [produtos.commodities@b3.com.br](mailto:produtos.commodities@b3.com.br) e com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelo telefone (11) 2565-5022 ou e-mails [suporteanegociacao@b3.com.br](mailto:suporteanegociacao@b3.com.br) e [negociacao@b3.com.br](mailto:negociacao@b3.com.br).

Rodrigo Nardoni  
Vice-Presidente de Tecnologia e  
Segurança Cibernética

José Ribeiro de Andrade  
Vice-Presidente de Produtos e Clientes