

3 de novembro de 2022
152/2022-VNC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Revisão dos parâmetros para os Túneis de Negociação**

A B3 informa que, a partir de 07/11/2022, passarão a valer novos parâmetros para o Mercado de Renda Variável e o Mercado de Futuros dos túneis de leilão por oscilação e de leilão por preço médio, bem como para os túneis de proteção de oscilação e de quantidade e túneis de rejeição, conforme tabelas abaixo.

O túnel de proteção de concentração para os Mercados de Renda Variável e de Futuros será desativado, permanecendo os túneis de proteção de oscilação e quantidade.

Esse procedimento dá continuidade ao processo de revisão trimestral dos parâmetros dos Túneis de Negociação, como consta no Comunicado Externo 041/2021-VNC.

Renda variável

a. Túneis de leilão por oscilação e de leilão por preço médio

	Leilão por oscilação		Leilão por preço médio	
Grupo	Parâmetro atual	Parâmetro novo	Parâmetro atual	Parâmetro novo
BDRs não patrocinados	3,0%	*	6,0%	7,5%

* Não houve alteração dos parâmetros.

b. Túnel de proteção por oscilação no período regular

	Túnel de proteção por oscilação	
Grupo	Parâmetro atual	Parâmetro novo
Ativos pertencentes aos demais índices	6,00%	5,00%
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	6,00%	5,00%
Ativos que negociam no "Mais"	6,00%	5,00%
ETFs e índices	6,00%	5,00%
Grupo de Fundos Imobiliários pertencentes a índice	6,00%	5,00%
ETF Renda Fixa	3,00%	1,50%

c. Túnel de proteção por oscilação nos calls de abertura e fechamento

	Túnel de proteção por oscilação	
Grupo	Parâmetro atual	Parâmetro novo
ETF Renda Fixa	3,00%	1,50%

d. Túnel de proteção por quantidade

Grupo	Instrumentos	Túnel de proteção por quantidade	
		Parâmetro atual	Parâmetro novo
Ativos pertencentes aos demais índices	GFSA3	400.000	550.000
Ativos pertencentes aos demais índices	AERI3	500.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	BRPR3	650.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	CBAV3	850.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	CSMG3	500.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	CXSE3	700.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	DMMO3	1.200.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	ESPA3	450.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	GMAT3	600.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	HBSA3	700.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	LIGT3	1.200.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	MLAS3	500.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	OPCT3	600.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	POMO4	500.000	Mantém
Ativos pertencentes aos demais índices	Demais	400.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	ARZZ3	400.000	850.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	BBAS3	2.500.000	2.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	CPFE3	2.500.000	2.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	HAPV3	4.000.000	6.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	HYPE3	2.500.000	1.900.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	IRBR3	2.500.000	3.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	PETR4	7.000.000	6.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	RDOR3	2.500.000	2.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	RENT3	2.000.000	1.300.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	RRRP3	2.500.000	2.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	TAE11	2.500.000	2.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	VIIA3	4.000.000	6.000.000
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	ABEV3	4.500.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	B3SA3	6.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	BBDC4	5.500.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	CIEL3	4.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	COGN3	3.500.000	Mantém

Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	EGIE3	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	ELET3	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	ELET6	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	ENGI11	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	ITSA4	5.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	ITUB4	5.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	MGLU3	8.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	PETR3	3.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	SBSP3	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	SLCE3	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	SUZB3	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	VALE3	3.500.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	VIVT3	2.000.000	Mantém
Ativos pertencentes aos índices IBOV ou IBXX	Demais	2.500.000	Mantém
Ativos que não pertencem a índice	BBVH11	50.000	50.000
Ativos que não pertencem a índice	BBVH12	50.000	50.000
Ativos que não pertencem a índice	ESPA1	-	900.000
Ativos que não pertencem a índice	ESUU11	-	15.000
Ativos que não pertencem a índice	IFCM1	-	350.000
Ativos que não pertencem a índice	INBR31	-	350.000
Ativos que não pertencem a índice	INBR32	-	450.000
Ativos que não pertencem a índice	INEP3	150.000	25.000
Ativos que não pertencem a índice	LLIS1	-	800.000
Ativos que não pertencem a índice	MOAR3	50.000	50.000
Ativos que não pertencem a índice	NUBR33	500.000	200.000
Ativos que não pertencem a índice	OIBR3	4.800.000	4.800.000
Ativos que não pertencem a índice	OIBR4	150.000	150.000
Ativos que não pertencem a índice	PDGR1	-	3.500.000
Ativos que não pertencem a índice	RNEW12	-	150.000
Ativos que não pertencem a índice	RZAG12	-	150.000
Ativos que não pertencem a índice	SAPR4	200.000	200.000
Ativos que não pertencem a índice	VGIA12	-	250.000
Ativos que não pertencem a índice	VIVR1	-	1.800.000
Ativos que não pertencem a índice	VLID11	-	250.000
Ativos que não pertencem a índice	Demais	100.000	Mantém
Ativos que negociam no "Mais"	Todos	100.000	Mantém

Ativos que negociam no Mercado de Balcão Organizado	Todos	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	AMZO34	50.000	75.000
BDRs não patrocinados	REGN34	50.000	10.000
BDRs não patrocinados	A1LB34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	ABBV34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	ACNB34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	ASML34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	BOEI34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	DEEC34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	DEOP34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	FDXB34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	LILY34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	LMTB34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	TGTB34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	TMCO34	10.000	Mantém
BDRs não patrocinados	Demais	50.000	Mantém
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	ADPR34	60.000	50.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BAAX39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BACW39	500.000	1.500.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BAER39	350.000	350.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BCHI39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BDVY39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEFA39	250.000	300.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEFV39	250.000	300.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEGD39	20.000	600.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEGU39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEWA39	150.000	150.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEWC39	150.000	150.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEWL39	200.000	300.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEWU39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEWW39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BEWZ39	100.000	150.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BFXI39	100.000	300.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BGWH39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIAU39	350.000	350.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIEU39	100.000	150.000

BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIHI39	350.000	2.000.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BILF39	150.000	200.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BITO39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIVB39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIVE39	150.000	150.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIVW39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIWF39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIWM39	20.000	300.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIXJ39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BIYW39	250.000	900.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BLBT39	100.000	150.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BNDA39	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BQUA39	100.000	250.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BQYL39	100.000	300.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BSLV39	100.000	350.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BUSM39	150.000	150.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	BVLU39	200.000	200.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	GDBR34	30.000	30.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	H1BI34	100.000	100.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	HONB34	30.000	40.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	KMBB34	30.000	50.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	Q1UA34	60.000	50.000
BDRs não patrocinados e não pertencentes a índice	Demais	100.000	60.000
ETFs Criptoemodas	BLOK11	-	100.000
ETFs Criptoemodas	Demais	500.000	Mantém
ETFs de índices	5GTK11	1.000.000	1.200.000
ETFs de índices	AGRI11	1.000.000	1.700.000
ETFs de índices	ALUG11	2.000.000	2.500.000
ETFs de índices	ASIA11	2.000.000	12.000.000
ETFs de índices	BBOV11	1.500.000	1.400.000
ETFs de índices	BBSD11	1.000.000	950.000
ETFs de índices	BDOM11	-	850.000
ETFs de índices	BNDX11	-	900.000
ETFs de índices	BOVB11	900.000	750.000
ETFs de índices	BOVS11	900.000	950.000
ETFs de índices	BOVV11	5.500.000	4.100.000

ETFs de índices	BTEK11	1.000.000	1.300.000
ETFs de índices	DIVO11	1.000.000	1.200.000
ETFs de índices	DNAI11	2.000.000	2.700.000
ETFs de índices	ECOO11	1.000.000	850.000
ETFs de índices	ELAS11	1.000.000	750.000
ETFs de índices	EMEG11	2.000.000	12.000.000
ETFs de índices	ESGB11	1.000.000	800.000
ETFs de índices	ESGD11	2.000.000	12.000.000
ETFs de Índices	ESGE11	2.000.000	12.500.000
ETFs de Índices	ESGU11	2.000.000	11.300.000
ETFs de Índices	EURP11	2.000.000	10.400.000
ETFs de índices	FIND11	1.000.000	750.000
ETFs de índices	FOOD11	-	900.000
ETFs de índices	GENB11	2.000.000	13.700.000
ETFs de Índices	GOVE11	1.000.000	1.700.000
ETFs de índices	HTEK11	1.000.000	1.800.000
ETFs de índices	JOGO11	1.000.000	1.600.000
ETFs de índices	MATB11	1.000.000	1.700.000
ETFs de índices	MILL11	2.000.000	2.500.000
ETFs de índices	NASD11	2.000.000	10.000.000
ETFs de índices	PEVC11	-	950.000
ETFs de índices	PIBB11	500.000	450.000
ETFs de índices	SCVB11	-	800.000
ETFs de índices	SHOT11	2.000.000	4.500.000
ETFs de índices	SMAC11	1.000.000	1.500.000
ETFs de índices	SMAL11	1.000.000	750.000
ETFs de índices	SPXB11	2.000.000	9.900.000
ETFs de índices	SVAL11	-	900.000
ETFs de índices	TECK11	2.000.000	2.500.000
ETFs de índices	URET11	2.000.000	9.800.000
ETFs de índices	USAL11	2.000.000	10.300.000
ETFs de Índices	USDB11	-	900.000
ETFs de Índices	USTK11	2.000.000	10.900.000
ETFs de índices	UTEC11	2.000.000	8.400.000
ETFs de índices	WRLD11	1.000.000	1.200.000
ETFs de índices	XBOV11	900.000	750.000

ETFs de índices	XINA11	2.000.000	14.700.000
ETFs de índices	BOVA11	1.500.000	Mantém
ETFs de índices	BOVX11	4.500.000	Mantém
ETFs de índices	BRAX11	900.000	Mantém
ETFs de índices	IBOB11	900.000	Mantém
ETFs de índices	IVVB11	400.000	Mantém
ETFs de índices	REVE11	1.000.000	Mantém
ETFs de índices	SPXI11	400.000	Mantém
ETFs de índices	Demais	2.000.000	Mantém
Fracionário Bovespa	Todos	10.000	Mantém
Fracionário demais índices	Todos	10.000	Mantém
Fracionários do "Mais"	Todos	10.000	Mantém
Fracionários do Mercado de Balcão Organizado	Todos	10.000	Mantém
Fracionários sem índice	Todos	10.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	BLMO11	2.000	1.000
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	IDGR11	100.000	400.000
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	LKDV11	-	10.000
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	RBTS11	-	10.000
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	VXXV11	15.000	40.000
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	ALMI11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	BICE11	10.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	BRIM11	10.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	BRIP11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	FLRP11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	HUSI11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	KEVE11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	MBRF11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	PQDP11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	RBRI11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	REIT11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	ROOF11	10.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	SEED11	150.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	SHPH11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	SOLR11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	ZIFI11	15.000	Mantém
Fundos Imobiliários que não pertencem a índice	Demais	100.000	Mantém

Grupo de Fundos Imobiliários pertencentes a índice	Todos	100.000	Mantém
Grupo de Finam e Finor	FNAM11	59.150.000	120.000.000
Grupo de Finam e Finor	FNOR11	89.750.000	220.000.000

Mercados futuros

a. Túneis de leilão por oscilação e de leilão por preço médio

Mercadoria	Grupo	Leilão por oscilação		Leilão por preço médio	
		Parâmetro atual	Parâmetro novo	Parâmetro atual	Parâmetro novo
CCM	M3	1,30%	1,10%	1,40%	*
Moedas US\$	O5	0,80%	*	2,00%	3,00%
Moedas US\$	O6	0,80%	*	2,00%	3,00%
SJC	N6	2,00%	2,50%	2,60%	*
SJC	N7	2,00%	2,50%	2,40%	2,60%
SOY	N1	2,20%	*	2,40%	4,00%
SOY	N2	2,20%	*	2,40%	4,00%
DAP	P4-Todos os vencimentos até o primeiro vencimento do próximo ano	75	110	60	100
DI1	D3	-	*	31	25
FRC	R2	10	14	15	21

* Não houve alteração dos parâmetros.

b. Túnel de proteção por oscilação e quantidade

Mercadoria	Grupo	Proteção de oscilação		Proteção de quantidade	
		Parâmetro atual	Parâmetro novo	Parâmetro atual	Parâmetro novo
BGI	K2	1,70%	2,50%	50	*
DAP	P4-Todos os vencimentos até o	60	*	2.350	3.500

	primeiro vencimento do próximo ano				
FRC	R2	20	27	3.000	*
SOY	N1	3,90%	4,00%	50	*
SOY	N2	3,90%	4,00%	50	*

* Não houve alteração dos parâmetros.

c. Túnel de rejeição

		Rejeição	
Mercadoria	Grupo	Parâmetro atual	Parâmetro novo
CCM	M3	2,60%	2,20%
SJC	N6	4,00%	5,00%
SJC	N7	4,00%	5,00%
SOY	N1	5,00%	6,00%
SOY	N2	5,00%	6,00%
DAP	P4-Todos nos vencimentos até o primeiro vencimento do próximo ano	150	220
DAP	P4-Demais vencimentos	150	220
DAP	P6	150	220
DI1	D3	32	50
FRC	R2	20	28

* Não houve alteração dos parâmetros.

Haverá ainda a desativação da regra de leilão de primeiro negócio para o Futuro de Soja FOB Santos com Liquidação Financeira (Platts), ou seja, caso não ocorram negócios na fase de pré-abertura, o primeiro negócio para o Futuro de Soja FOB Santos com Liquidação Financeira (Platts) da fase de negociação **não** será automaticamente submetido a leilão.

		Leilão de Primeiro Negócio	
Mercadoria	Grupo	Parâmetro atual	Parâmetro novo
SOY	N1	Sim	Não
SOY	N2	Sim	Não

Também serão alterados os parâmetros de cálculo de Amplitude Mínima de banda (AMB) dos túneis de leilão para o Contrato de Opções sobre Ações e ETFs, de acordo com a tabela:

Amplitude Mínima de Banda (AMB)		
Opções sobre ações e ETFS	Parâmetro atual	Parâmetro novo
Túnel de leilão	R\$ 0,15	R\$ 0,05

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