

23 de abril de 2020  
048/2020-VOP

## **COMUNICADO EXTERNO**

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

**Ref.: Alteração na Regra de Leilão de Primeiro Negócio para os Contratos Futuros Referenciados em Ibovespa, Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial, Cupom de IPCA, US Treasury Note de 10 anos e Moedas; para os Minicontratos Futuros Referenciados em Ibovespa e Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial; e para as Operações Estruturadas de Forward Rate Agreement**

Informamos que, a partir de **27/04/2020**, em função do programa de formador de mercado ou da metodologia de precificação de derivativos, que atualiza de forma dinâmica o preço de referência (centro de túnel) para cálculo dos túneis de negociação de leilão e de rejeição dos vencimentos de menor liquidez de um mesmo contrato, a B3 removerá a regra de leilão para o primeiro negócio do dia para os derivativos abaixo.

- Contrato Futuro de Ibovespa (IND) – grupos B2 (liquidez intermediária) e B6 (menor liquidez)
- Contrato Futuro Míni de Ibovespa (WIN) – grupos W6 (liquidez intermediária) e W7 (menor liquidez)
- Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial (DOL) – grupos C2 (liquidez intermediária) e C6 (menor liquidez)
- Contrato Futuro Míni de Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial (WDO) – grupos W8 (liquidez intermediária) e W9 (menor liquidez)
- Contrato Futuro de Cupom de IPCA (DAP) – grupo P6 (menor liquidez)
- Contrato Futuro referenciados em Moedas – grupo O1 e O6 (menor liquidez)
- Forward Rate Agreement de Cupom Cambial (FRC) – grupo R2 (menor liquidez)
- Contrato Futuro de US Treasury Note de 10 anos (T10) – grupo O2 (grupo único)

As tabelas com os instrumentos e os parâmetros utilizados no cálculo dos túneis de negociação estão disponíveis em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Soluções, Plataformas, PUMA Trading System, Participantes e traders, Regras e parâmetros de negociação, Parâmetros dos túneis de negociação.

Os parâmetros de atuação e os programas de Formador de Mercado estão disponíveis em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Produtos e Serviços, Negociação, Formador de mercado, Derivativos, Programas, Futuros, Tabela de programas de FM.

Destacamos que 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](http://www.b3.com.br), Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Negociação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelo e-mail [negociacao@b3.com.br](mailto:negociacao@b3.com.br) ou pelo telefone (11) 2565-5023.

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