

22 de novembro de 2017

019/2017-DO

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **PUMA Trading System BM&FBOVESPA – Implementação do Túnel de Proteção de Preço durante Leilões e Calls de Abertura e de Fechamento para Opções sobre Contratos Futuros e Disponíveis.**

A B3 informa que, a partir de **04/12/2017**, inclusive, implementará, na plataforma PUMA Trading System BM&FBOVESPA, o túnel de proteção de preço, durante leilões e calls de abertura e de fechamento, para as opções descritas nas tabelas abaixo, ampliando, assim, a lista de produtos divulgada nos Ofícios Circulares, 136/2015-DP, de 09/12/2015; 093/2016-DP, de 19/09/2016; e 027/2017-DP, de 29/03/2017.

Tabela 1

Contrato de Opção de Compra / Venda sobre Futuro de:	Código
Açúcar Cristal com Liquidação Financeira	OPF ACF
Boi Gordo com Liquidação Financeira	OPF BGI
Café Arábica Tipo 4/5	OPF ICF
Café Arábica Tipo 6/7	OPF KFE
Etanol Hidratado com Liquidação Financeira	OPF ETH

019/2017-DO

Milho com Liquidação Financeira	OPF CCM
Soja com Liquidação Financeira	OPF SFI
Taxa Média Depósitos Interfinanceiros de Um Dia – DI1	OPF D11, D12, D13 e D14
BVMF de Standard & Poors 500 – S&P 500	OPF ISP

Tabela 2

Contrato de Opção de Compra / Venda sobre Disponível de:	Código
Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial	OPD DOL
Índice de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia	OPD IDI
Índice da Taxa Média de Operações Compromissadas de Um Dia (ITC) com Lastro em Títulos Públicos Federais	OPD ITC
Padrão Ouro (250 gramas)	OPD OZ1

O túnel de proteção é o intervalo de variação de preços estabelecido pela B3, com o objetivo de prorrogar, automaticamente, o encerramento dos leilões ou dos calls de abertura e de fechamento, se o preço teórico infringir seus limites inferior ou superior. No caso de prorrogação, a B3 definirá o horário de encerramento dos leilões ou dos calls.

Os limites superior e inferior do túnel de proteção correspondem, respectivamente, às variações positiva e negativa sobre o centro de túnel, tendo como base o preço de referência, que será o preço mais recente entre o calculado pela B3 e o último negociado.

Adicionalmente, a B3 comunica que poderá modificar, revogar ou estabelecer novos limites superior e inferior para esse túnel no decurso da sessão de negociação e sem aviso prévio ao mercado, bem como disponibilizar o referido túnel para outros ativos.

019/2017-DO

As tabelas com os parâmetros utilizados no cálculo desse túnel de negociação estão disponíveis em www.bmfbovespa.com.br, Regulação, Regulamentos e manuais, Operações, Parâmetros dos Túneis de Negociação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Operações, pelos telefones (11) 2565-4213.

Atenciosamente,

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

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e
Clientes