

15 de março de 2022
031/2022-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Alteração no cálculo do preço de ajuste do contrato futuro de S&P 500 (ISP)**

A B3 informa que, a partir do dia **28 de março de 2022**, passará a calcular o preço de ajuste do contrato futuro de S&P 500 segundo a média aritmética ponderada dos negócios realizados entre 16h55 e 17h.

A metodologia completa pode ser consultada no manual de apreçamento, disponível em www.b3.com.br, Market Data e Índices, Serviços de dados, Market Data, Consultas, Mercado de Derivativos, Metodologia, Manual de Apreçamento da B3.

Quanto aos horários de negociação para contrato futuro de S&P 500 (ISP) e microcontrato futuro de S&P 500 (WSP), serão alterados a partir do dia 28 de março de 2022, conforme Anexo I deste Ofício Circular.

Os horários de negociação estão disponíveis em www.b3.com.br, Soluções, Plataformas, PUMA Trading System, Participantes e traders, Horário de negociação.



031/2022-PRE

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Produtos Listados e Dados pelos telefones (11) 2565-7748 ou 7249; e a Diretoria de Negociação Eletrônica pelo telefone (11) 2565-5022 ou e-mail negociacao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes

Anexo I do OFÍCIO CIRCULAR 031/2022- PRE

Contratos Futuros e de Opções e Operações Estruturadas Referenciados em Índice de Ações

Contrato	Código	Negociação Normal		Cancelamento de Ofertas		Call Eletrônico	Cancelamento de Ofertas		Negociação Estendida (D0)		Negociação After hours (D+1)	
		Início	Fim	Início	Fim	Início	Início	Fim	Início	Fim	Início	Fim
Futuro de S&P 500 com Liquidação Financeira Referenciada ao Preço do S&P 500 do CME Group	FUT ISP	9h ⁽¹⁾	17h55 ^{(2) (3)}	-	-	17h55	-	-	-	-	-	-
Microcontrato Futuro de S&P 500 com Liquidação Financeira Referenciada ao Preço do S&P 500 do CME Group	FUT WSP	9h ⁽¹⁾	17h55 ⁽²⁾	-	-	17h55	-	-	-	-	-	-
Rolagem do Contrato Futuro de S&P 500 com Liquidação Financeira	FUT RSP	9h ⁽¹⁾	18h ⁽²⁾	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Rolagem do Microcontrato Futuro de S&P 500 com Liquidação Financeira	FUT WS1	9h ⁽¹⁾	18h ⁽²⁾	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Opções de Compra e de Venda sobre Futuro de S&P 500	OPF ISP	9h ⁽¹⁾	18h ⁽²⁾	-	-	-	-	-	-	-	-	-

⁽¹⁾ A fase de pré-abertura terá início 5 minutos antes do início da fase de negociação.

⁽²⁾ No dia do vencimento, a negociação do contrato vincendo se encerrará às 10h30.

⁽³⁾ A apuração do preço de ajuste será das 16h55 às 17h.