



20 de abril de 2021  
060/2021-VOP

## COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listados B3

Ref.: **Novos Parâmetros para os Túneis de Negociação do Contrato Futuro de Cupom IPCA (DAP) e do Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (DI1)**

Informamos que, a partir de **26/04/2021**, passarão a valer novos parâmetros para os túneis de proteção por preço e de proteção por quantidade, bem como para os túneis de leilão por oscilação e de leilão por preço médio, para os Contratos Futuros de Cupom IPCA (DAP) e de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (DI1), conforme a seguir.

### 1. Contrato Futuro de Cupom de IPCA (DAP)

Vencimento	Grupo	Túnel de leilão por oscilação		Túnel de leilão por preço médio		Túnel de proteção por preço	
		Parâmetro atual	Novo parâmetro	Parâmetro atual	Novo parâmetro	Parâmetro atual	Novo parâmetro
Todos os vencimentos até o primeiro vencimento do próximo ano	P4	(+/-) 50 bps	(+/-) 50 bps	(+/-) 62 bps	(+/-) 60 bps	(+/-) 120 bps	(+/-) 60 bps
Demais vencimentos		(+/-) 50 bps	(+/-) 20 bps	(+/-) 62 bps	(+/-) 30 bps	(+/-) 120 bps	(+/-) 30 bps
Todos os vencimentos	P6	(+/-) 50 bps	(+/-) 20 bps	(+/-) 62 bps	(+/-) 30 bps	(+/-) 120 bps	(+/-) 30 bps

## 2. Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (DI1)

Vencimento	Grupo	Túnel de leilão por preço médio		Túnel de proteção por quantidade	
		Parâmetro atual	Novo parâmetro	Parâmetro atual	Novo parâmetro
Primeiro vencimento	D1	(+/-) 14 bps	(+/-) 10 bps	20.000	100.000
Primeiro vencimento do ano subsequente*					
Demais vencimentos				20.000	30.000
Todos os vencimentos	D2	(+/-) 22 bps	(+/-) 15 bps	8.000	8.000
Todos os vencimentos	D3	(+/-) 31 bps	(+/-) 31 bps	3.000	3.000

\* Quando o primeiro vencimento disponível à negociação for janeiro, será utilizado o primeiro vencimento do ano seguinte.

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.

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) 2565-5022.

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