

06 de julho de 2018

031/2018-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **Atualização da Regra para os Limites de Oscilação Diária.**

A B3 informa que, em **16/07/2018**, inclusive, entrará em vigor, para os contratos derivativos descritos abaixo, regra atualizada sobre a não utilização do limite de oscilação diária, a qual passará a ser aplicada exclusivamente na última sessão de negociação do vencimento do contrato, em vez das últimas três sessões.

Índices

- Futuro BVMF de Índice MICEX (MIX)
- Futuro de S&P 500 com Liquidação Financeira Referenciada ao Preço do S&P 500 do CME Group (ISP)
- Futuro BVMF do FTSE/JSE Top40 (JSE)
- Futuro BVMF do Índice Hang Seng (HSI)
- Futuro de Ibovespa (IND)
- Futuro de Índice Brasil-50 (BRI)
- Futuro de Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IAP)
- Futuro Míni de Ibovespa (WIN)

Taxas de Câmbio

- Futuro de Reais por Dólar Australiano (AUD)
- Futuro de Reais por Dólar Canadense (CAD)
- Futuro de Reais por Dólar Comercial (DOL)
- Futuro de Reais por Dólar da Nova Zelândia (NZD)

031/2018-PRE

- Futuro de Reais por Euro (EUR)
- Futuro de Reais por Franco Suíço (CHF)
- Futuro de Reais por Iene (JPY)
- Futuro de Reais por Iuan (CNY)
- Futuro de Reais por Libra Esterlina (GBP)
- Futuro de Reais por Lira Turca (TRY)
- Futuro de Reais por Peso Chileno (CLP)
- Futuro de Reais por Peso Mexicano (MXN)
- Futuro de Reais por Rande da África do Sul (ZAR)
- Futuro Míni de Reais por Dólar Comercial (WDO)
- Futuro Míni de Reais por Euro (WEU)

Taxas de Juro

- Futuro de Cupom Cambial (DDI)
- Futuro de Cupom Cambial Baseado em Operações Compromissadas de Um Dia (DCO)
- Futuro de Cupom de IPCA (DAP)
- Futuro de Taxa Média das Operações Compromissadas de Um Dia com Lastro em Títulos Públicos Federais (OC1)
- Futuro de Taxa Média de DI de Um Dia (DI1)
- Swap Cambial com Ajuste Periódico (SCC)
- Swap Cambial com Ajuste Periódico Baseado em Operação Compromissada de Um Dia (SCS)

Títulos da Dívida Externa

- Futuro de US Treasury Note de 10 Anos (T10)

Ressalta-se que, para os contratos futuros referenciados em commodities, os prazos para a perda de limite de oscilação permanecem inalterados.

A B3 poderá revogar ou alterar, a qualquer momento, os limites de oscilação dos contratos citados neste Ofício Circular, mediante comunicação prévia ao mercado.

031/2018-PRE

Os parâmetros utilizados no cálculo dos limites de oscilação diária estão disponíveis em www.bmfbovespa.com.br, Regulação, Regulamento e manuais, Operações, Parâmetros, Oscilação Diária de Negociação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelo telefone (11) 2565-4680 ou pelo e-mail controledeoperacoes@bvmf.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes