

27 de dezembro de 2017
139/2017-DO

COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: Processamento da Câmara BM&FBOVESPA em 29/12/2017 – Atualização do Preço de Ajuste dos Contratos Futuros de Moedas e Tratamento dos Arquivos BVBG.017 e BVBG.021.

A B3 informa que, em **29/12/2017** (sexta-feira), haverá atualização do preço de ajuste dos contratos futuros de moeda com vencimento em 02/01/2018 e algumas particularidades quanto ao processamento e ao envio dos arquivos BVBG.017 e BVBG.021, conforme a seguir.

Atualização do Preço do Ajuste dos Contratos Futuros de Moeda

- No final do dia **28/12/2017**, serão publicados normalmente todos os preços de ajuste dos contratos futuros de moeda estrangeira: AUD, CAD, NZD, EUR, CHF, JPY, CNY, GBP, TRY, CLP, MXN e ZAR.
- Para fins de cálculo do último ajuste dos contratos com vencimento em 02/01/2018, deverá ser utilizado o preço de ajuste que será divulgado no decorrer do dia **29/12/2017**.
- No dia **29/12/2017**, os preços de ajuste atualizados serão divulgados por meio de comunicado a ser enviado pela equipe da SSP – Suporte à Pós-Negociação.
- A única exceção será o contrato futuro de dólar, vencimento F18, para o qual deverá ser considerado o preço de ajuste divulgado no próprio dia **28/12/2017**.

Arquivo de Controle de Posições BVBG.017

- O arquivo BVBG.017 (PositionDetailsAccounts) será disponibilizado previamente no processamento de **28/12/2017**, porém sem as posições de balcão e sem a valorização das posições de swap cambial.
- Em **29/12/2017**, no decorrer do dia, será gerado e disponibilizado novo arquivo BVBG.017 completo com data de referência de 29/12, considerando-se também todas as posições de balcão e a valorização das posições de swap cambial.

Arquivo de Liquidação Financeira BVBG.021

- No processamento noturno de **28/12/2017**, o arquivo BVBG.021 (CashEntryNotificationbySettlementDate) será disponibilizado apenas com as liquidações brutas de renda fixa de balcão com liquidação em **29/12/2017**.
- No processamento noturno de **29/12/2017**, o arquivo BVBG.021 será disponibilizado com as informações da liquidação financeira com efetivação em 02/01/2018.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos até o dia 28/12/2017 com a Superintendência de Suporte à Pós-Negociação, pelo telefone (11) 2565-5000, opção 3, ou pelo e-mail ssp@bvmf.com.br.

Atenciosamente,

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