

27 de abril de 2023
068/2023-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Alteração na regra de arredondamento da quantidade de contratos da ponta curta a serem alocados e quantidade mínima de oferta de EDS de DI1 e EDS de DAP**

Informamos que, a partir de **29/05/2023**, inclusive, as Operações Estruturadas de DI1 (DIF e DII) e DAP (DAI e DAF) (Contratos) terão alterações em dois aspectos, conforme descrito abaixo.

1. Regra de arredondamento da quantidade alocada da ponta curta.
2. Quantidade mínima de oferta.

Em relação ao item 1, após a realização de um negócio em uma operação estruturada, atualmente, é apurada a quantidade de contratos da ponta curta que serão alocados de acordo com o item 3.a) dos Contratos:

Quantidade: quantidade de contratos negociados na operação estruturada multiplicada pelo ratio, indicado no item 2, **arredondado para o múltiplo mais próximo do lote-padrão da operação estruturada.**

Com a implementação na data mencionada, o arredondamento será alterado para o múltiplo mais próximo do lote-padrão do ativo subjacente da operação estruturada, de acordo com a definição abaixo.

Quantidade: quantidade de contratos negociados na operação estruturada multiplicada pelo ratio, indicado no item 2, **arredondado para o múltiplo mais próximo do lote-padrão do ativo subjacente da operação estruturada.**

Exemplo

A negociação de 100 contratos de EDS de DI1 (DIFX12Y34) geraria:

	Regra atual (até 28/05/2023)	Nova regra (a partir de 29/05/2023)
Ratio	0,772732	0,772732
Qtd negociada na estratégia	100	100
Qtd entregue de perna longa	100	100
Qtd calculada de perna curta a ser entregue	77,2732	77,2732
Qtd entregue de perna curta (arredondada)	75	77

Além disso, referente ao item 2, a quantidade mínima de oferta das operações estruturadas de DI1 e DAP também será alterada de 25 para 5 contratos.

As demais características técnicas dos contratos não terão quaisquer alterações e poderão ser consultadas em www.b3.com.br, Produtos e Serviços, Negociação, Juros, Taxa DI, Operações Estruturadas, para as Operações Estruturadas de DI1; e Produtos e Serviços, Negociação, Juros, Cupom IPCA, Operações Estruturadas, para as Operações Estruturadas de DAP.

A nova versão dos Contratos das Operações Estruturadas contemplando as alterações mencionadas neste Ofício Circular, estarão disponíveis em www.b3.com.br, Produtos e Serviços, Negociação, Juros, a partir de **29/05/2023**.

Destacamos que essas alterações estarão disponíveis em ambiente de certificação a partir de **02/05/2023**.



068/2023-PRE

Os participantes que desejarem validá-las poderão solicitar suporte à Superintendência de Suporte à Negociação, pelo telefone (11) 2565-5023 ou pelo e-mail tradingcertification@b3.com.br.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Juros e Moedas, pelos telefones (11) 2565-5661/5830.

Gilson Finkelsztain
Presidente

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes