

20 de dezembro de 2016

119/2016-DP

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados da BM&FBOVESPA – Segmentos BOVESPA e BM&F

Ref.: **Alteração nos Parâmetros de Negociação e Implementação de Túneis de Negociação para o Contrato Futuro US Treasury Note de 10 Anos (T10).**

A BM&FBOVESPA informa que, a partir de **09/01/2017**, inclusive, alterará os parâmetros de negociação do Contrato Futuro de US Treasury Note de 10 Anos (T10), conforme disposto neste Ofício Circular.

1. Negociação contínua

Os vencimentos desse contrato pertencentes ao grupo O2 serão submetidos à negociação contínua.

2. Túneis de negociação

A BM&FBOVESPA implementará túneis de rejeição, de leilão, de preço médio ponderado do ativo e de proteção para o referido contrato conforme detalhado abaixo.

2.1. Túnel de rejeição

Os limites superiores e inferiores desse túnel corresponderão à seguinte variação:



119/2016-DP

Contrato	Vencimento ou Série	Código do Grupo de Contratos	Negociação Contínua	Túnel de Rejeição (+/-)
Futuro de US T-Note	Todos os vencimentos	O2	Sim	1,00%

2.2. Túneis de leilão, de preço médio ponderado do ativo e de proteção

Os limites superiores e inferiores desses túneis corresponderão às seguintes variações:

Contrato	Vencimento ou Série	Código do Grupo de Contratos	Negociação Contínua	Túnel de Leilão (+/-)	Túnel de Preço Médio (+/-)	Túnel de Proteção (+/-)
Futuro de US T-Note	Todos os vencimentos	O2	Sim	0,25%	0,50%	1%

3. Disposições gerais

Os horários de negociação permanecem inalterados e estão disponíveis em www.bmfbovespa.com.br, Serviços, Negociação, PUMA Trading System BM&FBOVESPA, Participantes e traders, Horário de negociação, Derivativos, Taxa de Juros.

A BM&FBOVESPA poderá alterar os valores dos túneis de rejeição, de leilão, de preço médio ponderado do ativo e de proteção, bem como os parâmetros utilizados em seus cálculos, a qualquer momento durante a sessão de negociação, mediante aviso prévio ao mercado de 30 (trinta) minutos.

Os parâmetros utilizados nos cálculos dos referidos túneis poderão ser consultados em www.bmfbovespa.com.br, Regulação, Regulamentos e manuais, Operações, Parâmetros dos Túneis de Negociação, Contratos futuros e de opções referenciados em taxa de juro em dólares.

Os limites de oscilação do Contrato Futuro de US Treasury Note de 10 Anos permanecem inalterados.

Ressalta-se que será aplicada a regra de leilão de primeiro negócio para todos os vencimentos autorizados à negociação.



119/2016-DP

Por fim, aplica-se, subsidiariamente, a este Ofício Circular o Ofício Circular, 136/2015-DP, de 09/12/2015.

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

Atenciosamente,

Luis Otavio Saliba Furtado
Diretor Presidente em Exercício

Cícero Augusto Vieira Neto
Diretor Executivo de Operações,
Clearing e Depositária