



30 de julho de 2024
098/2024-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Lançamento das Operações Estruturadas de Forward Points com Contrato Futuro de Míni Dólar Comercial baseadas na Taxa USD/BRL da WMR FX Benchmarks**

Informamos que as Operações Estruturadas de Forward Points com Contrato Futuro de Míni Dólar Comercial baseadas na Taxa USD/BRL da WMR FX Benchmarks estarão disponíveis a partir de **05/08/2024**.

As especificações técnicas do contrato constam no Anexo deste Ofício Circular.

Mais informações sobre as Operações Estruturadas de Forward Points com Contrato Futuro de Míni Dólar Comercial baseadas na Taxa USD/BRL da WMR FX Benchmarks (FRW) estão disponíveis em <https://clientes.b3.com.br>, Roadmap, Projetos, FRW: Diferencial entre Spot USD/BRL WMR FX Benchmarks e Futuro de Míni Dólar.

Este Ofício Circular revoga e substitui integralmente o Ofício Circular 006/2024-VPC de 29/05/2024.



098/2024-PRE

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Produtos Listados, pelo telefone (11) 2565-6023 ou com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelos telefones (11) 2565-5021/5022 ou e-mails suporteanegociacao@b3.com.br e negociacao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

Mario Palhares
Vice-Presidente de Operações –
Negociação Eletrônica e CCP

Anexo do OFÍCIO CIRCULAR 098/2024-PRE

OPERAÇÕES ESTRUTURADAS DE FORWARD POINTS COM CONTRATO FUTURO DE MÍNI DÓLAR COMERCIAL BASEADAS NA TAXA USD/BRL DA WMR FX BENCHMARKS

1. Informações do contrato

Objeto	Contrato Futuro de Míni Dólar Comercial para vencimento-base, negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão
Código de negociação	FRW
Tamanho do contrato	1 Contrato de FRW = 1 Contrato Futuro de Míni Dólar
Cotação	BRL por USD1.000,00
Varição mínima de apregoação (tick size)	BRL0,10 por USD1.000,00
Lote-padrão	1 contrato
Abertura de posição	FRW0 (abertura de posição em D0)
Limites de oscilação diária	Não haverá limite para a cotação do FRW. Porém, os preços do Contrato Futuro de Míni Dólar Comercial, criados com base nos negócios de FRW, deverão enquadrar-se nos limites estabelecidos para tal contrato

2. Cálculo do preço do Contrato Futuro de Míni Dólar (WDO)

O vencimento-base será o primeiro vencimento em aberto do Contrato Futuro de Míni Dólar Comercial, até o antepenúltimo dia útil anterior a seu vencimento. A partir de então, o vencimento-base será o segundo vencimento em aberto, mantendo-se nessa condição até o antepenúltimo dia útil anterior à data de vencimento, quando se repetirá o processo.

098/2024-PRE

Note-se que a estratégia de forward points não se constitui em um contrato futuro específico. Trata-se de forma alternativa de negociação do Contrato Futuro de Míni Dólar Comercial, por meio de um valor a ser acrescido ou diminuído da cotação spot USD/BRL, divulgada pela WMR FX Benchmarks USD/BRL às 16h de Londres.

A negociação do FRW gerará, ao final do dia, posição no mercado futuro de míni dólar comercial.

O preço do contrato futuro (Ft), vencimento-base, será dado por:

$$Ft = (WMCot \times 1.000) + f$$

Onde:

Ft = preço do contrato futuro de míni dólar (WDO);

WMCot = preço gerado pela cotação spot USD/BRL divulgada pela WMR Reuters às 16h, horário de Londres; e

f = cotação negociada do FRW.

Os resultados financeiros da liquidação serão movimentados no dia útil subsequente à data de vencimento.

Caso a taxa USD/BRL da WMR FX Benchmarks não seja divulgada, a B3 poderá, a seu critério, arbitrar uma cotação para a obtenção do preço do contrato futuro. Caso a WMR venha a alterar posteriormente a taxa divulgada, a B3 poderá, a seu critério, não considerar essa alteração, para efeito de apuração da cotação do contrato futuro.

3. Condições especiais

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes, com base em seus regulamentos.

4. Lei de regência

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

5. Aplicação de normas e regulamentos da B3

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.