



19 de junho de 2015
052/2015-DO

COMUNICADO EXTERNO

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

Ref.: Alteração nos Parâmetros dos Túneis de Negociação dos Derivativos Negociados na Plataforma PUMA Trading System BM&FBOVESPA.

A BM&FBOVESPA informa que, a partir de **29/06/2015**, inclusive, alterará os valores de referência utilizados no cálculo dos túneis de negociação, que passarão de valores absolutos para valores percentuais.

Essa alteração abrangerá os seguintes derivativos:

- Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial (DOL), Operação Estruturada de Rolagem de Dólar (DR1) e Operação Estruturada de Estratégia de Forward Points com Contrato Futuro de Dólar Comercial (FRP);
- Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por: (i) Dólar Australiano (AUD), (ii) Dólar Canadense (CAD), (iii) Dólar da Nova Zelândia (NZD), (iv) Euro (EUR e EBR), (v) Franco Suíço (CHF), (vi) Iene (JPY), (vii) Iuan (CNY), (viii) Libra Esterlina (GBP), (ix) Lira Turca (TRY), (x) Peso Chileno (CLP), (xi) Peso Mexicano (MXN) e (xii) Rande da África do Sul (ZAR);
- Contrato Futuro Míni de Taxa de Câmbio de Reais por (i) Dólar Comercial (WDO) e (ii) Euro (WEU);
- Contrato Futuro de Ibovespa (IND) e Operação Estruturada de Rolagem de Ibovespa (IR1);
- Contrato Futuro Míni de Ibovespa (WIN);
- Contrato Futuro de Índice Brasil-50 (BRI);
- Contrato Futuro BVMF de (i) FTSE/JSE Top40 (JSE), (ii) Índice Hang Seng (HSI), (iii) Índice MICEX (MIX) e (iv) Índice S&P BSE SENSEX (BSE);
- Contrato Futuro de S&P 500 do CME Group (ISP) e Operação Estruturada



052/2015-DO

.2.

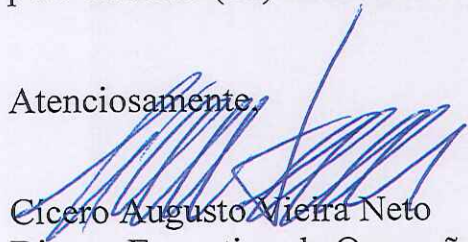
- de Rolagem de S&P 500 (RSP);
- Contrato Futuro de Açúcar Cristal com Liquidação Financeira (ACF) e Operação Estruturada de Rolagem de Açúcar Cristal (RAC);
 - Contrato Futuro de Boi Gordo com Liquidação Financeira (BGI) e Operação Estruturada de Rolagem de Boi Gordo (BR1);
 - Contrato Futuro de Café Arábica Tipo 4/5 (ICF) e Operação Estruturada de Rolagem de Café Arábica Tipo 4/5 (CR1);
 - Contrato Futuro de Café Arábica Tipo 6/7 (KFE) e Operação Estruturada de Rolagem de Café Arábica Tipo 6/7 (KR1);
 - Contrato Futuro de Etanol Anidro Carburante (ETN);
 - Contrato Futuro de Etanol Hidratado com Liquidação Financeira (ETH);
 - Contrato Futuro de Soja com Liquidação Financeira (SFI);
 - Contrato Futuro de Soja com Liquidação Financeira pelo Preço do Contrato Futuro Míni de Soja do CME Group (SJC);
 - Minicontrato Futuro de Petróleo com Liquidação Financeira pelo Preço do Contrato Futuro de Petróleo Light Sweet Crude Oil (WTI) do CME Group
 - Contrato Futuro de Milho com Liquidação Financeira (CCM) e Operação Estruturada de Rolagem de Milho com Liquidação Financeira (MR1); e
 - Contrato Disponível Padrão de (i) Ouro de 250 Gramas (OZ1D), (ii) Ouro de 10 Gramas (OZ2D) e (iii) Ouro de 0,225 Grama (OZ3D).

A BM&FBOVESPA poderá modificar os valores do túnel de rejeição, do túnel de leilão baseado no último preço atualizado e do túnel de leilão baseado no preço médio ponderado do ativo, bem como os parâmetros utilizados em seus cálculos, a qualquer momento e com aviso prévio de 30 minutos.

Os parâmetros utilizados no cálculo dos túneis de negociação estão disponíveis em www.bmfbovespa.com.br, Regulação, Regulamentos e Normas, Procedimentos Operacionais, Derivativos, Parâmetros, Divisão de Ativos por Grupos, sendo atualizados periodicamente.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Operações, pelo telefone (11) 2565-4680.

Atenciosamente,


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