



## NEGOCIE FUTURO DE DI COM O TAS

Tenha maior eficiência em negociar o preço de ajuste do Futuro de DI com essa nova estratégia

O TAS (Trade at Settlement) é um instrumento que permite a negociação do Futuro de DI a preço de ajuste acrescido de um diferencial, durante todo o pregão até o fim da janela de ajuste (9h às 16h20).

Conheça aqui todas as características dessa estratégia.

### Objeto de negociação

Contrato de DI1 negociado a partir do diferencial do preço de ajuste do mesmo dia. O diferencial negociado no TAS pode ser negativo, positivo ou zero (flat).

### Cotação

Taxa de juro efetiva anual, base 252 dias úteis, com até três casas decimais.

### Lote padrão

Mesmo lote padrão do DI1.

### Último Dia de Negociação

Mesma data do vencimento do DI1 subjacente.

### Horário de Negociação

09:00 as 16:20\* - Até o final do período de ajuste

\*O horário de negociação divulgado passa a valer após a implementação do novo modelo de apuração por VWAP. Até lá o horário será das 09h às 16h.

### Código de negociação

**DIT + MAA**  
(EX: DITF23)

### Tick Size

- 0,2 BP (vencimentos de até 3 meses);
- 0,5 BP (vencimentos de 4 a 60 meses);
- 1 BP (vencimentos acima de 60 meses).

### Data de Vencimento

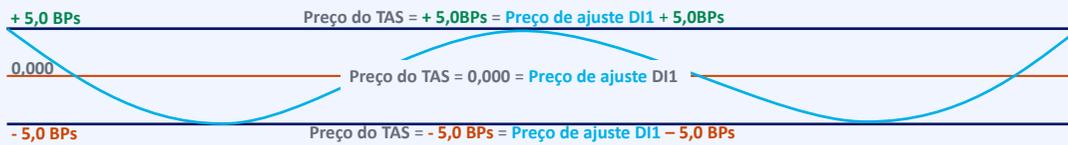
Mesma data do vencimento do DI1 subjacente.

### Meses de Vencimento

Todos os meses disponíveis no DI1.



## Características da Negociação



- Limite de oscilação diária: Entre - 5 BPs e + 5 BPs;
- Negociação independente do contrato Futuro de DI;
- Todas as ofertas serão aceitas, exceto RLP e as ofertas com validade GTC, GTD, MOC e MOA.

## Conheça o benefício

### Mitigação de erros



Quem opera na média, quanto menor for o negócio mais alto a chance de errar o ajuste. Com o TAS não há erros. Para negócios pequenos, ele quase sempre vai ser melhor.

## Tarifação

O TAS pertencerá à mesma família de produtos do Futuro de DI e seguirá o mesmo modelo de tarifação.

$$\text{Tarifa Única} = \text{Fator Contrato} \times (1 - \text{Redução por ADV}) \times \text{FR}$$

- Utilizará a mesma tabela de fator de risco da família para o cálculo do ADV e da tarifa única
- Volume negociado de DIT será somado com o volume negociados dos demais contratos da família para o cálculo da redução por ADV
- O DIT casa day trade também com os outros membros da família (EDS e DI1)

## Arquivos e Mensagens de Negociação

As mensagens e arquivos da negociação não terão alteração de estrutura ou inclusão de novos campos.

**BVBG.086:** conterà as informações de negociação dos instrumentos. As estatísticas de cada vencimento não serão acrescidas dos negócios do TAS.

**BVBG.028:** conterà os atributos do instrumento.

A negociação do TAS, de forma similar aos contratos de rolagem, não atualizará as estatísticas dos contratos de Futuro de DI, isto é, informações como preço mínimo, máximo, médio, último e etc. Não serão atualizadas quando um contrato de TAS for negociado.

## Aprofunde-se em detalhes

Para saber mais sobre a negociação de Futuro de DI com TAS, acesse a página do projeto no site [B3 Clientes](#) ou [clique aqui](#) para assistir ao Workshop Técnico dessa estratégia e [aqui](#) para acessar o material da apresentação.

## FALE COM A B3

Ficou com alguma dúvida? Entre em contato pelos contatos abaixo.

### Diretoria Executiva de Produtos Listados e Dados

☎ (11) 2565-6324/7119

### Diretoria de Negociação Eletrônica

☎ (11) 2565-5022

✉ [suporteanegociacao@b3.com.br](mailto:suporteanegociacao@b3.com.br)

✉ [negociacao@b3.com.br](mailto:negociacao@b3.com.br)

