

7 de dezembro de 2023
207/2023-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado e Balcão B3

Ref.: **Procedimentos para Tratamento de Novo Feriado Nacional no Dia 20 de Novembro**

Informamos aos participantes o tratamento a ser dado pela Câmara B3 no caso da sanção presidencial do Projeto de Lei 3268/2021, que torna feriado nacional o dia 20 de novembro, em comemoração ao Dia Nacional de Zumbi e da Consciência Negra.

O novo feriado de 20 de novembro será incluído no calendário dos sistemas da B3 na abertura da sessão de negociação após a publicação da sanção presidencial no Diário Oficial da União (DOU).

Portanto, na data da publicação (D+0) o calendário nos sistemas será o mesmo, sem contemplar o novo feriado. Na data seguinte à publicação (D+1), o calendário nos sistemas da Câmara B3 já terá o dia 20 de novembro como não útil.

Para efeitos desse tratamento, a data de referência da publicação no DOU (D+0) é definida das 00h00 até 23h59 do dia em que houver a efetiva disponibilização da edição do DOU publicamente, ou seja, o calendário será refletido nos sistemas

da B3 no dia útil seguinte dessa data de publicação desde que esta ocorra até 23h59.

1. Contratos futuros

O ajuste diário de posição em contratos futuros será calculado de forma regular observando o calendário vigente e a especificação do contrato. No fechamento de D+0 o preço do ajuste seguirá o calendário atual e no fechamento de D+1 o preço de ajuste será calculado conforme o novo calendário. Portanto, o ajuste diário a ser liquidado na janela de liquidação multilateral de D+2 terá o impacto financeiro da mudança na contagem de dias úteis até vencimento causado pela diferença de calendários entre D+0 e D+1.

O cálculo dos valores de curvas de derivativos de taxa de juros com ajuste diário, conforme previsto no Ofício Circular 115/2023-PRE, seguirá o calendário vigente na data de referência do cálculo, ou seja, na data de referência D+0, calendário atual, e na data de referência D+1, calendário com o dia 20 de novembro como não útil.

2. Opções listadas

Os prêmios de opções serão calculados de forma regular, utilizando o calendário vigente nos sistemas na data. Os prêmios de referência do fechamento de D+0 seguem o calendário atual. A partir da abertura da sessão de negociação de D+1 será considerado o novo calendário, inclusive para o cálculo dos prêmios de referência e as volatilidades implícitas do fechamento de D+1.

3. Empréstimo de ativos

As posições de empréstimo de ativos com vencimento exatamente em 20 de novembro de qualquer ano a partir de 2024, inclusive no processamento noturno

de D+0, terão o seu vencimento adiado para o dia útil seguinte em que houver sessão de negociação na B3. Os demais contratos permanecem com a data de vencimento inalterada.

4. Termo do mercado listado

As posições de termo com vencimento exatamente em 20 de novembro de qualquer ano a partir de 2024, inclusive no processamento noturno de D+0, terão o seu vencimento adiado para o dia útil seguinte em que houver sessão de negociação na B3. Os demais contratos permanecem com a data de vencimento inalterada.

5. Balcão B3

Para o Balcão B3, não haverá nenhuma alteração automática das características dos instrumentos financeiros.

Todas as posições que tenham liquidação financeira na data desse novo feriado terão a liquidação postergada para o próximo dia útil.

E, de forma geral, sobre esse novo feriado serão aplicadas as regras atuais para os feriados já existentes, de acordo com os respectivos sistemas e instrumentos financeiros.

6. Cálculo de risco

O novo calendário será aplicado para fins de cálculo de risco a partir do cálculo de fim de dia realizado um dia após (D+1) da publicação no DOU, impactando,



207/2023-PRE

portanto, a margem requerida a partir da abertura do segundo dia após a publicação no DOU (D+2).

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com o Atendimento B3, Liquidação, pelo telefone (11) 2565-5014 ou e-mail liquidacao@b3.com.br; Risco, pelo telefone (11) 2565-5030 ou e-mail risco@b3.com.br; e Balcão, pelo telefone (11) 2565-5044 ou e-mail op.derivativosbalcao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

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