

8 de fevereiro de 2017

012/2017-DP

OFÍCIO CIRCULAR

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

Ref.: **Alteração do Intervalo Mínimo do Preço de Exercício das Séries de Opções sobre o Índice de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (IDI) e da Operação Estruturada de Volatilidade de Taxa de Juro Spot (VID).**

A BM&FBOVESPA informa que, a partir de **20/02/2017**, inclusive, alterará o intervalo mínimo do preço de exercício das séries de opções de compra e de opções de venda sobre o Índice de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (IDI), bem como da Operação Estruturada de Volatilidade de Taxa de Juro Spot (VID).

Poderão ser cadastradas séries de opções sobre IDI, sob demanda de participantes, da seguinte forma:

- (i) séries com data de vencimento coincidente com os três primeiros meses calendários do Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (DI1) poderão ter intervalos mínimos de 25 pontos de índice; e
- (ii) séries com data de vencimento coincidente com os demais meses poderão ter intervalos mínimos de 100 pontos de índice, sem modificações nos procedimentos adotados atualmente.



012/2017-DP

Ressalta-se que a abertura de novas séries de opções sobre IDI, inclusive para os vencimentos dos três primeiros meses, somente será realizada sob demanda. Os pedidos para a abertura de séries devem ser elaborados de maneira fundamentada e encaminhados ao e-mail da Superintendência de Cadastro de Instrumentos, Leilões Especiais e Índices, cadastrodeinstrumentos@bvmf.com.br.

Adicionalmente, destaca-se que os vencimentos da Operação Estruturada de Volatilidade de Taxa de Juro Spot (VID) seguirão os mesmos critérios de abertura de séries de opções sobre IDI, indicados neste Ofício Circular.

Cabe à BM&FBOVESPA, a seu exclusivo critério, avaliar os aspectos técnicos e comerciais dos pedidos para abertura de séries de opções sobre IDI e de vencimentos da VID. Caso as novas séries e vencimentos da VID sejam aprovados, estarão disponíveis para negociação no dia útil seguinte ao da aprovação.

Este Ofício Circular revoga e substitui o Ofício Circular 027/2008-DG, de 25/03/2008.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Desenvolvimento de Mercados e Clientes, pelo telefone (11) 2565-7498, e com a Diretoria de Operações, pelo telefone (11) 2565-4340.

Atenciosamente,

Edemir Pinto
Diretor Presidente

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