

28 de outubro de 2009
066/2009-DP

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados BM&FBOVESPA (BVMF) – Segmento BM&F

Ref.: Contratos Futuros de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia – Alteração na Regra de Túnel de Negociação.

A BM&FBOVESPA implantará, a partir de **03/11/2009**, exclusivamente para os contratos futuros de taxa média de depósitos interfinanceiros de um dia, alterações no mecanismo de túnel de negociação, a saber:

- Os valores do túnel de rejeição serão idênticos aos do túnel de leilão;
- O leilão automático para esses contratos ocorrerá somente quando não houver negócio na fase de pré-abertura para o contrato; e
- Existirão três grupos de negociação para esses contratos: D1, D2 e D3, sendo que a diferença entre eles se dará nos valores estipulados para os túneis, na quantidade máxima por oferta e na condição para realização de leilão no caso de operações diretas.


Para os contratos pertencentes ao grupo D3, o registro de operações diretas será permitido somente por meio de realização de leilão no sistema GTS.

A divisão dos contratos por grupos de negociação, bem como os parâmetros referentes aos túneis, encontram-se disponíveis em www.bmf.com.br > Boletim > Normas de Negociação > Túnel de Leilão > Divisão de Ativos por Grupo.

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

Atenciosamente,


Edemir Pinto
Diretor Presidente


Cicero Augusto Vieira Neto
Diretor Executivo de Operações e TI

Anexo ao Ofício Circular 066/2009-DP

Contratos Futuros e de Opções Referenciados em Taxa de Juro em Reais

Contrato ou Operação Estruturada	Vencimento ou Série	Código do Grupo de Contratos	Negociação Contínua	Registro de Direto sem Leilão	Túnel de Rejeição		Túnel de Leilão (bps)	Quantidade Máxima por Oferta
					Ofertas de Compra (bps)	Ofertas de Venda (bps)		
DII	DIIZ09	D1	Sim	Sim	+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII F10				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII G10				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII H10				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII J10				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII N10				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII V10				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII F11				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII J11				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII N11				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII V11				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII F12				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII J12				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
	DII N12				+/-6	+/-6	+/-6	50.000
DII V12	+/-6	+/-6	+/-6	50.000				
DII	DII F13	D2	Sim	Sim	+/-12	+/-12	+/-12	20.000
	DII J13				+/-12	+/-12	+/-12	20.000
	DII N13				+/-12	+/-12	+/-12	20.000
	DII V13				+/-12	+/-12	+/-12	20.000
	DII F14				+/-12	+/-12	+/-12	20.000
	DII F17				+/-12	+/-12	+/-12	20.000
DII	Demais vencimentos	D3	Sim	Não	+/-18	+/-18	+/-18	10.000

Contrato ou Operação Estruturada	Vencimento ou Série	Código do Grupo de Contratos	Negociação Contínua	Registro de Direto sem Leilão	Túnel de Rejeição		Túnel de Leilão (bps)	Quantidade Máxima por Oferta
					Ofertas de Compra (bps)	Ofertas de Venda (bps)		
OPF DI	Todos	D0	Não	Não	ND	ND	ND	10.000
OPD IDI	Todos	E0	Não	Não	ND	ND	ND	10.000
OPF VF	Todos	V1	Não	Não	ND	ND	ND	10.000
OPD VID	Todos	V2	Não	Não	ND	ND	ND	10.000