



3 de dezembro de 2021

156/2021-PRE

## OFÍCIO CIRCULAR

Revogado pelo Ofício Circular 164-2022-PRE, de 24 de novembro de 2022.

Participantes do Listado B3

Ref.: **Alteração dos Limites de Oscilação Diária – Contratos Futuros DI1 e Taxa Média das Operações Compromissadas de Um Dia OC1**

Informamos que, em **06/12/2021**, inclusive, entrarão em vigor novos valores de limites de oscilação diária para os Contratos Futuros de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (DI1) e de Taxa Média das Operações Compromissadas de Um Dia com Lastro em Títulos Públicos Federais (OC1).

Os limites de oscilação diária de preço para os contratos futuros de DI1 e OC1 serão definidos conforme tabela abaixo.

| <b>Intervalo</b>        | <b>Atual Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Atual Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> |
|-------------------------|---|---|--|--|
| Até 1 mês               | -35   | 35  | -41  | 41   |
| Entre 1 mês e 2 meses   | -43   | 43  | -51  | 51   |
| Entre 2 meses e 3 meses | -50   | 50  | -62  | 62   |

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

INFORMAÇÃO PÚBLICA – PUBLIC INFORMATION

| <b>Intervalo</b>                          | <b>Atual Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Atual Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> |
|---|---|---|--|--|
| Entre 3 meses e 4 meses                   | -54   | 57  | -67  | 72   |
| Entre 4 meses e 5 meses                   | -57   | 64  | -72  | 82   |
| Entre 5 meses e 6 meses                   | -60   | 70  | -78  | 92   |
| Entre 6 meses e 7 meses                   | -62   | 74  | -79  | 96   |
| Entre 7 meses e 8 meses                   | -64   | 78  | -81  | 100  |
| Entre 8 meses e 9 meses                   | -65   | 82  | -83  | 104  |
| Entre 9 meses e 10 meses                  | -67   | 85  | -85  | 109  |
| Entre 10 meses e 11 meses                 | -69   | 89  | -87  | 113  |
| Entre 11 meses e 12 meses                 | -70   | 93  | -89  | 117  |
| Entre 12 meses e 1 ano e 3 meses          | -74   | 97  | -90  | 120  |
| Entre 1 ano e 3 meses e 1 ano e 6 meses   | -77   | 102   | -92  | 122  |
| Entre 1 ano e 6 meses e 1 ano e 9 meses   | -80   | 106   | -94  | 125  |
| Entre 1 ano e 9 meses e 2 anos            | -83   | 110   | -96  | 128  |
| Entre 2 anos e 2 anos e 3 meses           | -85   | 112   | -97  | 129  |
| Entre 2 anos e 3 meses e 2 anos e 6 meses | -87   | 114   | -98  | 130  |

| <b>Intervalo</b>                          | <b>Atual Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Atual Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> |
|---|---|---|--|--|
| Entre 2 anos e 6 meses e 2 anos e 9 meses | -89   | 116   | -99  | 130  |
| Entre 2 anos e 9 meses e 3 anos           | -90   | 118   | -100   | 131  |
| Entre 3 anos e 3 anos e 3 meses           | -91   | 119   | -100   | 132  |
| Entre 3 anos e 3 meses e 3 anos e 6 meses | -92   | 119   | -100   | 132  |
| Entre 3 anos e 6 meses e 3 anos e 9 meses | -92   | 120   | -101   | 132  |
| Entre 3 anos e 9 meses e 4 anos           | -93   | 120   | -101   | 132  |
| Entre 4 anos e 4 anos e 3 meses           | -94   | 121   | -102   | 133  |
| Entre 4 anos e 3 meses e 4 anos e 6 meses | -94   | 122   | -102   | 133  |
| Entre 4 anos e 6 meses e 4 anos e 9 meses | -95   | 122   | -102   | 133  |
| Entre 4 anos e 9 meses a 6 anos           | -95   | 123   | -103   | 134  |

| <b>Intervalo</b>                | <b>Atual Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Atual Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Mínimo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> | <b>Novo Limite<br/>Máximo de<br/>Oscilação<br/>(bps)</b> |
|---------------------------------|---|---|--|--|
| Entre 6 anos e 7 anos e 6 meses | -95   | 124   | -103   | 135  |
| Acima de 7 anos e 6 meses       | -95   | 125   | -103   | 136  |

Ressalta-se que, na última sessão de negociação anterior ao vencimento para os contratos DI1 e OC1, os limites de oscilação diária dispostos neste Ofício Circular não serão utilizados.

O limite de oscilação será determinado com base no preço de ajuste em taxa do dia anterior de cada vencimento autorizado à negociação. O enquadramento dos vencimentos dos contratos futuros de DI1 e OC1 nas faixas da tabela será atualizado mensalmente, no quinto dia útil anterior ao último dia do mês.

A B3 poderá revogar ou alterar, a qualquer momento, os limites de oscilação descritos neste Ofício Circular, mediante comunicação prévia ao mercado.

Os parâmetros utilizados no cálculo dos limites de oscilação diária estão disponíveis em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Soluções, Plataformas, Puma Trading System, Participantes e traders, Regras e parâmetros de negociação, Oscilação Diária de Negociação.



156/2021-PRE

Este Ofício Circular revoga e substitui o Ofício Circular 034/2018-VOP, de 28/06/2018.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelo telefone (11) 2565-5022 ou pelo e-mail [negociacao@b3.com.br](mailto:negociacao@b3.com.br).

Gilson Finkelsztain  
Presidente

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