

19 de setembro de 2016

093/2016-DP

OFÍCIO CIRCULAR

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

Ref.: **Plataforma PUMA Trading System BM&FBOVESPA – Implementação do Túnel de Proteção de Preço durante Leilões e Calls de Abertura e de Fechamento.**

A BM&FBOVESPA informa que, a partir de **24/10/2016**, inclusive, implementará, em sua plataforma PUMA Trading System, o Túnel de Proteção de Preço, durante leilões e calls de abertura e de fechamento, para os valores mobiliários negociados em seu mercado de bolsa indicados na tabela abaixo:

Contratos Derivativos e Operações Estruturadas	
Futuro de Ibovespa (IND)	Rolagem de Futuro Míni de Reais por Dólar Comercial (WD1)
Rolagem de Ibovespa (IR1)	Futuro de Reais por Dólar Australiano (AUD)
Futuro Míni de Ibovespa (WIN)	Futuro de Reais por Dólar Canadense (CAD)
Rolagem de Futuro Míni de Ibovespa (WI1)	Futuro de Reais por Dólar da Nova Zelândia (NZD)
Futuro de S&P 500 com Liquidação Financeira ao Preço do S&P 500 do CME Group (ISP)	Futuro de Reais por Franco Suíço (CHF)
Rolagem do Contrato Futuro de S&P 500 com Liquidação Financeira Referenciado no Preço do S&P 500 do CME Group (RSP)	Futuro de Reais por Iene (JPY)



093/2016-DP

Contratos Derivativos e Operações Estruturadas	
Futuro de Índice Brasil-50 (BRI)	Futuro de Reais por Iuan (CNY)
Futuro BVMF do FTSE/JSE Top40 (JSE)	Futuro de Reais por Libra Esterlina (GBP)
Futuro BVMF do Índice Hang Seng (HSI)	Futuro de Reais por Lira Turca (TRY)
Futuro BVMF do Índice MICEX (MIX)	Futuro de Reais por Peso Chileno (CLP)
Futuro BVMF do Índice SENSEX (BSE)	Futuro de Reais por Peso Mexicano (MXN)
Futuro de Reais por Dólar Comercial (DOL)	Futuro de Reais por Rande da África do Sul (ZAR)
Rolagem de Reais por Dólar Comercial (DR1)	Futuro de Reais por Euro (EUR)
Forward Points com Futuro de Dólar (FRP0 e FRP1)	Futuro Míni de Reais por Euro (WEU)
Futuro Míni de Reais por Dólar Comercial (WDO)	–
Mercado a Vista ⁽¹⁾	
Ações	Brazilian Depositary Receipts – BDRs Não Patrocinados (Nível I)
Brazilian Depositary Receipts – BDRs Patrocinados (Níveis II e III)	Direitos de Subscrição
Recibos de Subscrição	Bônus de Subscrição
Cotas de Fundos de Índice de Ações – ETF de Ações	Cotas de Fundos de Índice Estrangeiro – ETF Estrangeiro
Cotas de Fundos de Investimento Imobiliário – FII	Cotas de Fundos de Investimento em Participações
Cotas de Fundos de Investimento em Ações	Certificados de Potencial Adicional de Construção (Cepac)
Cotas de Finam	Cotas de Finor
Cotas de Fiset	Cotas de Funres
Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)	Certificados de Recebíveis do Agronegócio (CRAs)
Debêntures	Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC)
Letras Financeiras	Notas Promissórias

⁽¹⁾ O túnel de proteção não estará disponível para operações de lote fracionário, a termo e de opções.

O túnel de proteção é o intervalo de variação de preços estabelecido pela BM&FBOVESPA, com o objetivo de prorrogar, automaticamente, o



093/2016-DP

encerramento dos leilões ou dos calls de abertura e de fechamento, se o preço teórico infringir seus limites inferior ou superior. No caso de prorrogação, a BM&FBOVESPA definirá o horário de encerramento dos leilões ou dos calls.

Os limites superior e inferior do túnel de proteção correspondem, respectivamente, à variação positiva e negativa sobre o centro de túnel, sendo calculados com base no preço do último negócio realizado antes do início do leilão, ou, quando da ausência deste, nos preços de referência (ou os de fechamento ou de ajuste).

A BM&FBOVESPA poderá modificar, revogar ou estabelecer novos limites superior e inferior para esse túnel no decurso da sessão de negociação e sem aviso prévio ao mercado.

As tabelas com os parâmetros utilizados no cálculo desse túnel de negociação estão disponíveis em www.bmfbovespa.com.br, Regulação, Regulamentos e manuais, Operações, Túneis de Negociação.

Este Ofício Circular complementa o Ofício Circular 136/2015-DP, de 09/12/2015.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Operações, pelos telefones (11) 2565-4680/4304.

Atenciosamente,

Edemir Pinto
Diretor Presidente

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