



21 de dezembro de 2012
073/2012-DP

OFÍCIO CIRCULAR

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

Ref.: Contrato Futuro de DI1 - Alteração dos Limites de Oscilação Diária.

Informamos que, a partir de **02/01/2013**, entrarão em vigor novos valores de limite de oscilação para o Contrato Futuro de DI1.

O limite será determinado com base no preço de ajuste do dia anterior de cada vencimento autorizado à negociação (expresso em PU). A partir do preço de ajuste, será apurada a taxa de juros equivalente, expressa em forma efetiva anual, base 252 dias úteis, com até três casas decimais, denominada taxa de juro de referência.

Sobre a taxa de juro de referência, serão apurados os limites de oscilação de preços mínimo e máximo, para todos os vencimentos, conforme a fórmula:

- Limite mínimo: – 80 pontos-base (-0,80%), aplicados de forma aditiva sobre a taxa de juro de referência;
- Limite máximo: + 80 pontos-base (+0,80%), aplicados de forma aditiva sobre a taxa de juro de referência.

Ressaltamos que o limite de oscilação não é utilizado nos últimos três dias de negociação do contrato. A BM&FBOVESPA poderá revogar ou alterar, a qualquer momento, o limite de oscilação de preços de qualquer contrato e de qualquer vencimento, mediante comunicação prévia ao mercado.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Gerência de Plataforma de Negociação, pelos telefones (11) 2565-4680.

Atenciosamente,

Edemir Pinto
Diretor Presidente

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