

8 de fevereiro de 2024
006/2024-VPC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Balcão B3

Ref.: **Procedimentos a serem adotados para instrumentos financeiros devido ao novo feriado nacional no dia 20 de novembro**

Informamos o tratamento a ser dado para os instrumentos financeiros do Balcão B3 no dia 20/11, em razão da publicação da Lei 14.759/2023, que instituiu o feriado nacional em comemoração ao Dia Nacional de Zumbi e da Consciência Negra.

1) Renda Fixa

- As posições e os eventos que tenham liquidação financeira na data de 20/11 terão a liquidação postergada para o próximo dia útil.
- O cálculo dos instrumentos PREFIXADOS, PÓS-FIXADOS ou demais indexadores acrescidos de CUPOM/SPREAD com vencimento após 20/11/2024 terá impacto no cálculo da curva:
 - caso o critério de cálculo seja em base de 252 dias, os contratos serão impactados pelo feriado de acordo com o cálculo descrito no caderno de fórmulas;
 - caso o critério de cálculo seja em base de 360/365 dias, os contratos não sofrerão impactos.
- A B3 recalculará a taxa de juros dos instrumentos emitidos pelo “Registro Simplificado Prefixado Final”, preservando o valor a ser pago na data de vencimento conforme o cadastro do ativo.

2) Derivativos de Balcão sem contraparte central e COE

- Contratos com liquidação financeira (evento, vencimento ou agendamento de liquidação em 20/11) terão a liquidação postergada para o próximo dia útil (D+1).
- Contratos com *fixing*:
 - na data do feriado, 20/11, considerarão a data do dia útil anterior (D-1), independentemente da forma de indicação do *fixing* em formato de data específica (DD/MM/AAAA) ou deslocamento (D-N);
 - asiático, caso uma das datas seja o feriado, será desconsiderada a respectiva data, de tal forma a média passará a ser formada por um dia a menos.
- Não haverá verificação de barreiras (KI, KO) no dia do feriado.
- Contratos registrados com parâmetros em percentuais, cuja data de referência para se obterem os respectivos valores seja a data de feriado, considerarão a data do dia útil anterior (D-1).
- Contratos com ativo-subjacente (curvas), cuja metodologia de contagem de dias para cálculo de juros sejam:
 - dias úteis (exemplos: taxa de juros e índices de preços), terão 01 dia a menos de *accrual* no contrato;
 - dias corridos (exemplo: cupom de uma taxa de câmbio), não serão impactados no *accrual* do contrato.
- Especificamente para o BOX registrado no módulo “Estratégia e Opção”, onde são informados “Valor Aplicação” e “Valor de Resgate”, a B3 fará automaticamente o recálculo da taxa de aplicação equivalente, preservando o valor a ser pago na data de vencimento conforme informado no registro.

006/2024-VPC

A B3 não fará nenhuma alteração automática das características dos instrumentos financeiros. Os Participantes, porém, caso queiram, poderão fazê-lo diretamente no sistema B3, mediante procedimento próprio, de acordo com a particularidade de cada instrumento financeiro.

O novo feriado de 20/11 foi incluído nos sistemas e calendários da B3 de acordo com os Ofícios 207/2023-PRE e 215/2023-PRE.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Depositária e Operações de Balcão, Central de Atendimento de Ativos e Liquidação Financeira pelo telefone (11) 2565-5041 ou e-mail operacaobalcao@b3.com.br; e Central de Atendimento de Derivativos pelo telefone (11) 2565-5044 ou e-mail op.derivativosbalcao@b3.com.br.

.José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes