



01 de julho de 2015

064/2015-DP

OFÍCIO CIRCULAR

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

Ref.: Tratamento a ser dado pelo Serviço de Empréstimo de Ativos (BTC) e pela Câmara de Ações para as Cotas de Fundo de Índice iShares BM&FBOVESPA MidLarge Cap Fundo de Índice (MILA11).

Conforme Fato Relevante divulgado, em 30/06/2015, pelo Citibank Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A., administradora do iShares BM&FBOVESPA MidLarge Cap Fundo de Índice (Administradora e Fundo, respectivamente), foram aprovados pela Assembleia Geral de Cotistas o encerramento e a liquidação do Fundo. A integralização ou o resgate das cotas no mercado primário e o último dia de negociação no mercado de bolsa serão em 10/07/2015, inclusive.

1. Tratamento do Serviço de Empréstimo de Ativos (BTC)

Os contratos de empréstimo de cotas de fundo MILA11 terão seu vencimento antecipado para 07/07/2015. Caso haja falha da entrega das cotas no vencimento e essa falha não seja sanada até 08/07/2015, será emitida recompra das cotas, que deverá ser executada, impreterivelmente, em 10/07/2015. As recompras não executadas e não canceladas até 14/07/2015 serão revertidas em 15/07/2015, com base no preço médio de negociação da cota MILA11 do dia 10/07/2015.

A partir de 07/07/2015, inclusive, não será permitida a inserção de ofertas doadoras ou tomadoras dessa cota no sistema de empréstimo de ativos (BTC).



064/2015-DP

2. Procedimentos da Câmara de Ações para liquidação de negócios e substituição de garantia

Os negócios realizados em 10/07/2015 que não forem liquidados por falha de entrega das cotas no dia 15/07/2015 serão, excepcionalmente, liquidados financeiramente em 16/07/2015, com base no preço médio de negociação da cota MILA11 do dia 10/07/2015.

As recompras relativas a negócios efetuados em dias anteriores a 10/07/2015 e que não forem executadas ou canceladas até 15/07/2015 serão, excepcionalmente, revertidas em 16/07/2015, com base no preço médio de negociação da cota do dia 10/07/2015. Na ausência desse preço, será adotado, para os tratamentos citados neste Ofício Circular, preço teórico da cota, tendo como referência a carteira do fundo no dia 10/07/2015.

Adicionalmente, a partir de 10/07/2015, inclusive, o intervalo de margem das cotas do fundo MILA11 para cálculo de margem das operações do mercado a vista será elevado para 100%.


As cotas MILA11 depositadas como garantia na Câmara de Ações e na Câmara de Compensação e Liquidação da BM&FBOVESPA deverão ser substituídas até 10/07/2015.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte à Pós-Negociação, pelo telefone (11) 2565-5000, opção 3, ou pelo e-mail ssp@bvmf.com.br.

Atenciosamente,



Edemir Pinto
Diretor Presidente



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