

## OPERAÇÃO ESTRUTURADA DE TRADE AT SETTLEMENT DE FUTURO DE DI

### 1. Informações do Produto

O Trade at Settlement de Futuro de DI (“DIT”) é uma operação estruturada em que é negociado um vencimento de contrato futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (“Contrato Futuro de DI”) ao preço de ajuste do dia acrescido de um diferencial de taxa.

Por se tratar de uma operação estruturada, o DIT não representa um novo contrato e não possui posições em aberto ao final do dia, mas apenas permite que o investidor negocie um vencimento de Contrato Futuro de DI a preço de ajuste do dia acrescido de um diferencial. Portanto, as operações são automaticamente geradas e as movimentações financeiras e os resultados financeiros são apurados e liquidados da forma prevista pelas regras vigentes aplicáveis uma operação comum no Contrato Futuro de DI, disponíveis no site da B3.

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de juro definida pela acumulação da Taxa DI, divulgada pela B3, até o vencimento do contrato, negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3).
<b>Código de negociação</b>	DIT.
<b>Cotação</b>	Taxa de juros efetiva anual, base 252 dias úteis, com até três casas decimais.
<b>Último dia de negociação</b>	Sessão de negociação imediatamente anterior ao vencimento.
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses.
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	0,002 ponto de taxa para os contratos com prazo de vencimento de até 3 meses; 0,005 ponto de taxa para os contratos com prazo de vencimento de 4 a 60 meses; e 0,01 ponto de taxa para os contratos com prazo de vencimento acima de 60 meses.

## 2. Características das Operações Geradas Automaticamente

### a) Operação Automática de Contrato Futuro de DI

- **Código de Negociação:** DI1.
- **Cotação:** Taxa de juros efetiva anual, base 252 Dias Úteis, com três casas decimais.
- **Vencimento:** Vencimento negociado no DIT.
- **Quantidade:** Idêntica à quantidade de contratos negociados no DIT.
- **Natureza da Operação (Compra ou Venda):** Idêntica à da operação realizada no DIT.
- **Preço:** Será definido conforme a seguinte fórmula:

$$PO = \frac{100.000}{\left(1 + \frac{iO}{100}\right)^{\frac{n}{252}}}$$

Onde:

PO = preço da operação, em PU;

n= número de dias úteis, compreendidos no período entre a data da operação, inclusive, e a data de vencimento do contrato, exclusive;

iO = preço da operação em taxa, definido pela fórmula:

$$iO = iA_t + i$$

Onde:

iA<sub>t</sub> = taxa de ajuste do contrato na data “t”, para o vencimento respectivo, definida pela seguinte formula:

$$iA_t = \left( \left( \frac{100.000}{PA_t} \right)^{\frac{252}{n}} - 1 \right) \times 100$$

PA<sub>t</sub> = preço de ajuste em PU do contrato na data “t”, para o vencimento respectivo;

i = taxa de juro negociada, expressa em percentual.

### **3. Condições especiais**

Nas situações em que o preço resultante do Futuro de DI (diferencial de taxa negociado no DIT + preço de ajuste) proveniente do DIT ultrapassar o limite de oscilação diária, será permitido que o comitente receba o Futuro de DI fora deste limite, no valor correspondente à diferença entre o limite de oscilação diária e o preço resultante do limite ultrapassado.

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **4. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **5. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, manuais, regras e procedimentos divulgados pela B3.