

COMUNICADO AO MERCADO

BM&FBOVESPA divulga balanço de operações de setembro

- ✓ Recorde histórico de média diária de volume financeiro e média diária de número de negócios no segmento Bovespa.
- ✓ Estoque de títulos do agronegócio registrados na BM&FBOVESPA totalizou R\$ 27,08 bilhões, ante R\$ 25,49 bilhões no mês anterior.

Segmento Bovespa

O volume financeiro total no segmento Bovespa atingiu R\$ 160,43 bilhões, em setembro, ante R\$ 164,89 bilhões, em agosto de 2012. A média diária atingiu o recorde histórico de R\$ 8,44 bilhões, ante R\$ 7,16 bilhões no mês anterior. O recorde anterior era de R\$ 8,28 bilhões, de fevereiro de 2012. O número total de negócios atingiu 16.915.818 em setembro, enquanto em agosto foi de 18.259.374. A média diária de negócios atingiu o recorde histórico de 890.306, ante 793.886 no mês anterior. O recorde anterior era de 889.633, de maio de 2012.

Ações

As ações que registraram maior giro financeiro em setembro foram: VALE PNA, com R\$ 15,32 bilhões; PETROBRAS PN, com R\$ 9,58 bilhões; ITAUUNIBANCO PN, com R\$ 6,84 bilhões, VALE ON, com R\$ 4,23 bilhões; e BRADESCO PN, com R\$ 4,21 bilhões.

Índices

O Ibovespa encerrou setembro aos 59.175 pontos, com alta de 4,2%.

As ações que obtiveram as maiores altas do Ibovespa em setembro foram: B2W VAREJO ON (+33,63%), USIMINAS PNA (+24,17%), USIMINAS ON (+22,57%), GOL PN (+19,28%) e SUZANO PAPEL PNA (+18,44%). As maiores baixas foram: CESP PNB (-31,16%), CEMIG PN (-29,06%), ROSSI RESID ON (-17,27%), TRANS. PAULISTA PN (-16,45%) e CIELO ON (-14,03%)

Em setembro, os demais índices calculados pela Bolsa apresentaram as seguintes performances: BDRX (2,74%, a 1.560 pontos); IBRA (2,67%, a 1.950 pontos); IBXL (3,14%, a 8.667 pontos); IBXX (2,79% a 20.965 pontos); ICO2 (0,73% a 1.086 pontos); ICON (5,42%, a 2.151 pontos); IDIV (0,66% a 3.223 pontos); IEEX (-8,27%, a 30.091 pontos); IFIX (1,76%, a 1.532 pontos); IFNC (-0,44% a 3.652 pontos); IGCT (1,71% a 2.020 pontos); IGCX (2,30% a 7.413 pontos); IGNM (3,56%, a 1.598 pontos); IMAT (10,97%, a 1.747 pontos); IMOB (5,95% a 925 pontos); INDX (6,49% a 11.257 pontos); ISEE (1,22% a 2.271 pontos); ITAG (1,99%, a 9.736 pontos); IVBX (1,31% a 6.625 pontos); MLCX (2,63%, a 932 pontos); SMLL (2,92%, a 1.467 pontos); e UTIL (-11,56%, a 2.821 pontos).

Valor de mercado

O valor de mercado (capitalização bursátil) das 367 empresas com ações negociadas na BM&FBOVESPA, ao final de setembro, foi de R\$ 2,41 trilhões. Em agosto, esse valor era de R\$ 2,36 trilhões, referente a 368 companhias.

Níveis diferenciados

Em setembro, as 179 empresas integrantes dos Níveis Diferenciados de Governança Corporativa da BM&FBOVESPA representavam 65,32% do valor de mercado, 83,32% do volume financeiro e 85,74% dos negócios realizados no mercado a vista. Ao final de agosto, eram 181 empresas, que representavam 65,56% do valor de mercado, 77,52% do volume financeiro e 85,76% da quantidade de negócios.

Remuneração a acionistas

Em setembro de 2012, as empresas listadas na BM&FBOVESPA pagaram a seus acionistas R\$ 1,50 bilhão. Desse montante, R\$ 856,29 milhões referem-se a dividendos e R\$ 345,49 milhões a juros sobre capital próprio. Em agosto de 2012, os valores pagos foram de R\$ 2,74 bilhões no total, dos quais R\$ 1,25 bilhão refere-se a dividendos e R\$ 809,11 milhões a juros sobre capital próprio.

Participação dos mercados

Em setembro, o mercado a vista (lote-padrão) respondeu por 95,2% do volume financeiro; seguido pelo de opções, com 3,6%; e pelo mercado a termo, com 1,2%. O After Market movimentou R\$ 750,92 milhões, com a realização de 52.243 negócios, ante R\$ 755,71 milhões e 58.342 transações no mês anterior.

Participação dos investidores

Em setembro, os investidores estrangeiros lideraram a movimentação financeira no segmento Bovespa, com participação de 40,53% ante 40,02%, em agosto. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que tiveram participação de 30,65%, ante 32,34%. As pessoas físicas movimentaram 16,99%, ante 18,85%. As instituições financeiras ficaram com 7,46% ante 7,83%; e as empresas, com 4,34%, ante 0,94% do mês anterior.

Investimento Estrangeiro

Em 2012, os investimentos estrangeiros nos papéis de empresas brasileiras até setembro atingiu volume positivo de R\$ 3,16 bilhões, resultado de R\$ 4,36 bilhões (dos quais R\$ 4,16 bilhões ofertadas no Brasil) em distribuições públicas e o saldo negativo de R\$ 1,20 bilhões na negociação no mercado secundário da BM&FBOVESPA.

No mês de setembro, o balanço da negociação dos investidores estrangeiros na BM&FBOVESPA foi negativo em R\$ 4,17 bilhão, resultado de vendas no valor de R\$ 67,06 bilhões e de compras de ações de R\$ 62,89 bilhões.

A participação dos estrangeiros nas ofertas públicas de ações, incluindo IPO's, representa 51,2% do total de R\$ 8,51 bilhões das operações realizadas com Anúncios de Encerramento publicados até 02 de outubro de 2012, conforme tabela disponível na sala de imprensa do site.

Investidores individuais

O número de contas de investidores pessoas físicas no mercado de ações foi de 568.900 em setembro. Ao final de agosto, o número era de 573.641.

ETFs

Os 14 ETFs (Exchange Traded Funds, na sigla em inglês) negociados na BM&FBOVESPA totalizaram 97.083 negócios, em setembro, ante 103.649 em agosto. O volume financeiro foi de R\$ 2 bilhões, ante R\$ 2,54 bilhões em agosto. O ETF BOVA11, que replica o Ibovespa, obteve volume financeiro de R\$ 1,86 bilhão em 89.819 negócios, ante um volume de R\$ 2,28 bilhões e 87.168 negócios registrados no mês anterior.

Empréstimos de ações

Em setembro, o número de operações com empréstimos de ações foi de 97.899, ante 113.502 em agosto. O volume financeiro totalizou R\$ 59,52 bilhões, ante R\$ 67,34 bilhões no mês anterior.

Renda fixa privada

Em setembro, o mercado de renda fixa privada da Bolsa totalizou R\$ 30,43 milhões, ante R\$ 76,78 milhões em agosto, somados os negócios realizados no Bovespa Fix e Soma Fix. Deste total, R\$ 25,12 milhões são referentes às negociações de Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs) e R\$ 5,31 milhões de Debêntures.

Fundos de Investimento Imobiliários

No mês de setembro, os FIIs movimentaram R\$ 249,60 milhões, em 37.171 negócios. No mês anterior, o volume financeiro registrado foi de R\$ 293,65 milhões, em 38.469 negócios. O mês de setembro

encerrou com 83 fundos imobiliários registrados e autorizados à negociação nos mercados de bolsa e balcão da BM&FBOVESPA.

Segmento BM&F

Os mercados do segmento BM&F totalizaram 49.782.932 contratos negociados e volume financeiro de R\$ 3,75 trilhões em setembro, ante 60.486.696 contratos e giro de R\$ 4,06 trilhões em agosto. Ao final do último pregão de setembro, o número dos contratos em aberto, no total do mercado, foi de 45.847.287, ante 39.795.832 em agosto.

Derivativos financeiros

O futuro de juro (DI) contabilizou 27.200.748 contratos negociados, ante 28.708.180, em agosto. O dólar comercial futuro encerrou setembro com 5.790.552 contratos negociados, ante 6.109.886 no mês anterior. O futuro de Ibovespa apresentou 1.708.490 contratos, ante 2.180.924.

Minicontratos

Em setembro, foram negociados 3.174.548 minicontratos derivativos, ante 4.278.488 em agosto. O mercado futuro do Ibovespa negociou 3.054.964 minicontratos, ante 4.122.221. O dólar comercial futuro totalizou negociação de 117.532 minicontratos, ante 152.896 em agosto. Os minicontratos futuros encerraram setembro com 38.057 posições em aberto, ante 27.146 no mês anterior.

Derivativos de commodities

Em setembro, foram negociados 205.109 contratos futuros e de opções sobre futuro de commodities agropecuárias, ante 234.674 em agosto. Ao final do período, foram registrados 136.767 contratos em aberto, ante 149.197 no mês anterior.

O número de contratos negociados de futuros e de opções de boi gordo foi de 119.094, em setembro, ante 109.384 em agosto. O milho fechou o período com total de 61.895 contratos, entre futuros e opções, ante 90.496 no mês anterior. O café arábica encerrou setembro com 13.337 contratos, enquanto em agosto o total foi de 21.991. A soja registrou negociação de 4.943 contratos em setembro, ante 6.546 no mês anterior. O etanol hidratado registrou 5.840 contratos negociados, ante 6.257.

Títulos do agronegócio

O estoque de títulos do agronegócio registrados na BM&FBOVESPA totalizou R\$ 27,08 bilhões, ante R\$ 25,49 bilhões em agosto, somando todas as operações realizadas no Sistema de Registro de Títulos do Agronegócio (SRTA). O estoque de LCAs (Letra de Crédito do Agronegócio) totalizou R\$ 25,38 bilhões, ante R\$ 23,86 bilhões, em agosto.

Ouro a vista

O mercado disponível de ouro (250 gramas) negociou 1.419 contratos, ante 706 em agosto. O volume financeiro totalizou R\$ 40,06 milhões em setembro, ante R\$ 18,83 milhões no mês anterior.

Dólar a vista

O dólar a vista (dólar pronto) totalizou 161 negócios, com giro financeiro de US\$ 201 milhões em setembro. No período anterior, foram registrados 164 negócios, com volume financeiro de US\$ 168 milhões. O volume de dólares negociado em todo mercado interbancário e registrado na Clearing de Câmbio da Bolsa, em setembro, foi de US\$ 37,71 bilhões e 2.964 negócios, ante US\$ 38,56 bilhões, com 3.114 negócios, em agosto.

Renda fixa pública

O volume financeiro do mercado secundário de renda fixa pública na BM&FBOVESPA, em setembro, foi de R\$ 1,81 bilhão, ante R\$ 1,91 bilhão em agosto, somando-se todas as operações realizadas no Sisbex. O volume total representa as negociações realizadas com operações compromissadas e definitivas.

Participação dos investidores

As instituições financeiras lideraram a movimentação financeira nos mercados do segmento BM&F em setembro, com participação de 34,39%, ante 32,62%, em agosto. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que representaram 33,53%, ante 35,96% em agosto. No mesmo período, os

investidores estrangeiros alcançaram 26,89%, ante 25,37%. As pessoas físicas encerraram o mês com participação de 3,97%, ante 4,41%; e as empresas, 1,11%, ante 1,64% em agosto.

Investidores individuais

Ao final de setembro, a quantidade de investidores pessoas físicas com ao menos uma conta ativa na Clearing de Derivativos foi de 134.357, ante 130.241 no mês anterior.

DMA

Segmento BM&F

Em setembro, as negociações realizadas via Acesso Direto ao Mercado (DMA, na sigla em inglês) no segmento BM&F* registraram 28.238.693 contratos negociados em 3.230.715 negócios. No mês anterior, o número de contratos negociados foi de 33.284.800 em 4.284.785 negócios.

Os volumes negociados por tipo de DMA no segmento BM&F foram:

DMA tradicional – 12.204.992 contratos negociados em 1.047.232 negócios, ante 11.963.478 contratos e 1.367.477 negócios em agosto;

DMA via provedor (incluindo o roteamento de ordens com o Sistema Globex) – 9.668.449 contratos negociados em 233.990 negócios, ante 12.402.882 contratos e 292.153 negócios em agosto;

DMA via conexão direta – 2.691 contratos negociados em 266 negócios, ante 2.834 contratos e 279 negócios em agosto; e

DMA via co-location – 6.362.561 contratos negociados em 1.949.227 negócios, ante 8.915.606 contratos e 2.624.876 negócios em agosto.

Em setembro, as negociações realizadas por investidores estrangeiros apresentados à BM&FBOVESPA pela CME (que utilizam o sistema de roteamento de ordens Globex-PUMA Trading System ou que acessam os mercados da Bolsa via co-location) totalizaram 2.603.157 contratos negociados, em 794.767 negócios. Em agosto, os totais foram 3.856.153 contratos negociados, em 1.195.902 negócios.

Segmento BOVESPA

Em setembro, as negociações realizadas via DMA no segmento BOVESPA* totalizaram volume financeiro de R\$ 120,26 bilhões em 17.668.544 negócios. No mês anterior, o volume financeiro foi de R\$ 123,05 bilhões em 19.107.739 negócios.

Os volumes negociados por tipo de DMA no segmento BOVESPA foram:

DMA tradicional – R\$ 79,45 bilhões em 11.114.384 negócios, ante R\$ 84,53 bilhões em 12.927.744 negócios em agosto;

DMA via provedor – R\$ 6,23 bilhões em 776.921 negócios, ante R\$ 3,37 bilhões em 533.092 negócios em agosto;

DMA via conexão direta – R\$ 2,35 bilhões em 151.180 negócios, ante R\$ 2,60 bilhões em 198.057 negócios em agosto; e

DMA via co-location – R\$ 32,22 bilhões em 5.626.059 negócios, ante R\$ 32,55 bilhões em 5.448.846 negócios em agosto.

** O acesso direto aos sistemas de negociação da BM&FBOVESPA é realizado por DMA modelos 1, 2, 3 e 4.*

No modelo 1 ou DMA tradicional, o cliente acessa o sistema de negociação por intermédio da estrutura tecnológica da corretora.

No modelo 2 ou DMA via provedor, ele não utiliza a estrutura anterior e se conecta aos sistemas por um provedor de acesso autorizado. O acesso via roteamento de ordens com o Globex, no segmento BM&F, é uma forma de DMA modelo 2.

No modelo 3 ou DMA via conexão direta, o acesso às plataformas de negociação da Bolsa ocorre via conexão direta.

No modelo 4 ou DMA via co-location, o cliente instala seu próprio computador dentro da Bolsa.

Notas: Os volumes negociados por tipo de acesso incluem as duas partes do negócio (compra e venda).

Os volumes por tipo de acesso de ambos os segmentos passaram a ser divulgados de forma consolidada no balanço de operações da BM&FBOVESPA a partir de maio de 2009.

São Paulo, 03 de outubro de 2012.

Eduardo Refinetti Guardia

Diretor Executivo Financeiro, Corporativo e de Relações com Investidores