

COMUNICADO AO MERCADO

BM&FBOVESPA divulga balanço de operações de outubro

- ✔ Volume financeiro com empréstimos de ações aumentou de R\$ 59,52 bilhões para R\$ 74,52 bilhões.
- ✔ Número de contratos negociados no segmento BM&F passou de 49.782.932 para 65.363.903.
- ✔ Fundos de Investimento Imobiliários movimentaram recorde histórico de R\$ 351,09 milhões.

Segmento Bovespa

O volume financeiro total no segmento Bovespa atingiu R\$ 146,67 bilhões, em outubro, ante R\$ 160,43 bilhões, em setembro de 2012. A média diária foi de R\$ 6,66 bilhões, ante R\$ 8,44 bilhões no mês anterior. O número total de negócios atingiu 15.819.697 em outubro, enquanto em setembro foi de 16.915.818. A média diária de negócios foi de 719.077 ante 890.306 no mês anterior.

Ações

As ações que registraram maior giro financeiro em outubro foram: VALE PNA, com R\$ 13,03 bilhões; PETROBRAS PN, com R\$ 9,62 bilhões; ITAUUNIBANCO PN, com R\$ 5,36 bilhões, OGX PETROLEO ON, com R\$ 4,56 bilhões; e CIELO ON, com R\$ 3,87 bilhões.

Índices

O Ibovespa encerrou outubro aos 57.068 pontos, com queda de 3,5%.

As ações que obtiveram as maiores altas do Ibovespa em outubro foram: KLABIN PN (+12,55%), LOJAS RENNER ON (+10,75%), DASA ON (+10,66%), ALL AMER LAT ON (+10,26%) e HYPERMARCAS ON (+8,46%). As maiores baixas foram: OGX PETROLEO ON (-23,41%), LLX LOG ON (-21,18%), MMX MINER ON (-19,11%), ELETROPAULO PN (-18,12%) e GAFISA ON (-16,37%)

Em outubro, os demais índices calculados pela Bolsa apresentaram as seguintes performances:

BDRX (-2,73%, a 1.517 pontos); IBRA (-0,80%, a 1.935 pontos); IBXL (-1,39%, a 8.547 pontos); IBXX (-1,07% a 20.741 pontos); ICO2 (-0,34% a 1.083 pontos); ICON (4,57%, a 2.249 pontos); IDIV (0,88% a 3.251 pontos); IEEX (-4,57%, a 28.716 pontos); IFIX (-2,05%, a 1.500 pontos); IFNC (-2,62% a 3.556 pontos); IGCT (-0,29% a 2.014 pontos); IGCX (-0,32% a 7.389 pontos); IGNM (-0,32%, a 1.593 pontos); IMAT (-1,34%, a 1.723 pontos); IMOB (-4,06% a 887 pontos); INDX (0,41% a 11.303 pontos); ISEE (-0,55% a 2.259 pontos); ITAG (-1,02%, a 9.637 pontos); IVBX (-0,66% a 6.582 pontos); MLCX (-0,83%, a 924 pontos); SMLL (-0,58%, a 1.458 pontos); e UTIL (-1,45%, a 2.780 pontos).

Valor de mercado

O valor de mercado (capitalização bursátil) das 365 empresas com ações negociadas na BM&FBOVESPA, ao final de outubro, foi de R\$ 2,36 trilhões. Em setembro, esse valor era de R\$ 2,41 trilhões, referente a 367 companhias.

Níveis diferenciados

Em outubro, as 177 empresas integrantes dos Níveis Diferenciados de Governança Corporativa da BM&FBOVESPA representavam 64,84% do valor de mercado, 81,10% do volume financeiro e 87,06% dos negócios realizados no mercado a vista. Ao final de setembro, eram 179 empresas, que representavam 65,32% do valor de mercado, 83,32% do volume financeiro e 85,74% da quantidade de negócios.

Participação dos mercados

Em outubro, o mercado a vista (lote-padrão) respondeu por 95,4% do volume financeiro; seguido pelo de opções, com 3,2%; e pelo mercado a termo, com 1,4%. O After Market movimentou R\$ 781,94 milhões, com a realização de 58.334 negócios, ante R\$ 750,92 milhões e 52.243 transações no mês anterior.

Participação dos investidores

Em outubro, os investidores estrangeiros lideraram a movimentação financeira no segmento Bovespa, com participação de 41,55% ante 40,53%, em setembro. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que tiveram participação de 31,76%, ante 30,65%. As pessoas físicas movimentaram 16,63%, ante 16,99%. As instituições financeiras ficaram com 8,79% ante 7,46%; e as empresas, com 1,24%, ante 4,34% do mês anterior.

Investimento Estrangeiro

Em 2012, os investimentos estrangeiros nos papéis de empresas brasileiras até outubro atingiram volume positivo de R\$ 1,93 bilhão, resultado de R\$ 4,36 bilhões (dos quais R\$ 4,16 bilhões ofertadas no Brasil) em distribuições públicas e o saldo negativo de R\$ 2,43 bilhões na negociação no mercado secundário da BM&FBOVESPA.

No mês de outubro, o balanço da negociação dos investidores estrangeiros na BM&FBOVESPA foi negativo em R\$ 1,23 bilhão, resultado de vendas no valor de R\$ 61,41 bilhões e de compras de ações de R\$ 60,18 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 06 de novembro 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 571.890 em outubro. Ao final de setembro, o número era de 568.900.

ETFs

Os 14 ETFs (Exchange Traded Funds, na sigla em inglês) negociados na BM&FBOVESPA totalizaram 89.580 negócios, em outubro, ante 97.083 em setembro. O volume financeiro foi de R\$ 2,16 bilhões, ante R\$ 2 bilhões em setembro. O ETF BOVA11, que replica o Ibovespa, obteve volume financeiro de R\$ 1,97 bilhão em 78.509 negócios, ante um volume de R\$ 1,86 bilhão e 89.819 negócios registrados no mês anterior.

Empréstimos de ações

Em outubro, o número de operações com empréstimos de ações foi de 108.538, ante 97.899 em setembro. O volume financeiro totalizou R\$ 74,52 bilhões, ante R\$ 59,52 bilhões no mês anterior.

Renda fixa privada

Em outubro, o mercado de renda fixa privada da Bolsa totalizou R\$ 80,02 milhões, ante R\$ 30,43 milhões em setembro, somados os negócios realizados no Bovespa Fix e Soma Fix. Deste total, R\$ 9,68 milhões são referentes às negociações de Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs) e R\$ 69,12 milhões de Debêntures.

Fundos de Investimento Imobiliários

No mês de outubro, os FIIs movimentaram recorde histórico de R\$ 351,09 milhões, em 27.677 negócios. No mês anterior, o volume financeiro registrado foi de R\$ 249,60 milhões, em 37.171 negócios. O mês de outubro encerrou com 84 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 65.363.903 contratos negociados e volume financeiro de R\$ 4,42 trilhões em outubro, ante 49.782.932 contratos e giro de R\$ 3,75 trilhões em setembro. Ao final do último pregão de outubro, o número dos contratos em aberto, no total do mercado, foi de 46.476.554, ante 45.847.287 em setembro.

Derivativos financeiros

O futuro de juro (DI) contabilizou 35.066.507 contratos negociados, ante 27.200.748, em setembro. O dólar comercial futuro encerrou outubro com 4.707.629 contratos negociados, ante 5.790.552 no mês anterior. O futuro de Ibovespa apresentou 1.822.235 contratos, ante 1.708.490.

Minicontratos

Em outubro, foram negociados 3.735.144 minicontratos derivativos, ante 3.174.548 em setembro. O mercado futuro do Ibovespa negociou 3.653.424 minicontratos, ante 3.054.964. O dólar comercial futuro totalizou negociação de 79.042 minicontratos, ante 117.532 em setembro. Os minicontratos futuros encerraram outubro com 20.142 posições em aberto, ante 38.057 no mês anterior.

Derivativos de commodities

Em outubro, foram negociados 215.267 contratos futuros e de opções sobre futuro de commodities agropecuárias, ante 205.109 em setembro. Ao final do período, foram registrados 148.648 contratos em aberto, ante 137.089 no mês anterior.

O número de contratos negociados de futuros e de opções de boi gordo foi de 128.442, em outubro, ante 119.094 em setembro. O milho fechou o período com total de 60.366 contratos, entre futuros e opções, ante 61.895 no mês anterior. O café arábica encerrou outubro com 19.777 contratos, enquanto em setembro o total foi de 13.337. A soja registrou negociação de 3.890 contratos em outubro, ante 4.943 no mês anterior. O etanol hidratado registrou 2.792 contratos negociados, ante 5.840.

Títulos do agronegócio

O estoque de títulos do agronegócio registrados na BM&FBOVESPA totalizou R\$ 30,28 bilhões, ante R\$ 27,08 bilhões em setembro, 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\$ 28,59 bilhões, ante R\$ 25,38 bilhões, em setembro.

Ouro a vista

O mercado disponível de ouro (250 gramas) negociou 1.566 contratos, ante 1.419 em setembro. O volume financeiro totalizou R\$ 44,61 milhões em outubro, ante R\$ 40,06 milhões no mês anterior.

Dólar a vista

O dólar a vista (dólar pronto) totalizou 144 negócios, com giro financeiro de US\$ 148 milhões em outubro. No período anterior, foram registrados 161 negócios, com volume financeiro de US\$ 201 milhões. O volume de dólares negociado em todo mercado interbancário e registrado na Clearing de Câmbio da Bolsa, em outubro, foi de US\$ 37,90 bilhões e 2.808 negócios, ante US\$ 37,71 bilhões, com 2.964 negócios, em setembro.

Renda fixa pública

O volume financeiro do mercado secundário de renda fixa pública na BM&FBOVESPA, em outubro, foi de R\$ 334,7 milhões, ante R\$ 1,81 bilhão em setembro, somando-se todas as operações realizadas no Sisbex. O volume total representa as negociações realizadas com operações compromissadas e definitivas.

Participação dos investidores

Os investidores institucionais lideraram a movimentação financeira nos mercados do segmento BM&F em outubro, com participação de 36,01%, ante 33,53%, em setembro. Na segunda posição, ficaram as instituições financeiras, que representaram 35,54%, ante 34,39% em setembro. No mesmo período, os investidores estrangeiros alcançaram 22,56%, ante 26,89%. As pessoas físicas encerraram o mês com participação de 3,98%, ante 3,97%; e as empresas, 1,89%, ante 1,11% em setembro.

Investidores individuais

Ao final de outubro, a quantidade de investidores pessoas físicas com ao menos uma conta ativa na Clearing de Derivativos foi de 137.916, ante 134.357 no mês anterior.

DMA

Segmento BM&F

Em outubro, as negociações realizadas via Acesso Direto ao Mercado (DMA, na sigla em inglês) no segmento BM&F* registraram 35.153.998 contratos negociados em 3.624.644 negócios. No mês anterior, o número de contratos negociados foi de 28.238.693 em 3.230.715 negócios.

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

DMA tradicional – 17.563.619 contratos negociados em 1.220.502 negócios, ante 12.204.992 contratos e 1.047.232 negócios em setembro;

DMA via provedor (incluindo o roteamento de ordens com o Sistema Globex) – 10.881.852 contratos negociados em 239.990 negócios, ante 9.668.449 contratos e 233.990 negócios em setembro;

DMA via conexão direta – 1.961 contratos negociados em 310 negócios, ante 2.691 contratos e 266 negócios em setembro; e

DMA via co-location – 6.706.566 contratos negociados em 2.163.842 negócios, ante 6.362.561 contratos e 1.949.227 negócios em setembro.

Em outubro, 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 2.688.497 contratos negociados, em 871.913 negócios. Em setembro, os totais foram 2.603.157 contratos negociados, em 794.767 negócios.

Segmento BOVESPA

Em outubro, as negociações realizadas via DMA no segmento BOVESPA* totalizaram volume financeiro de R\$ 111,11 bilhões em 16.715.211 negócios. No mês anterior, o volume financeiro foi de R\$ 120,26 bilhões em 17.668.544 negócios.

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

DMA tradicional – R\$ 75,28 bilhões em 10.938.561 negócios, ante R\$ 79,45 bilhões em 11.114.384 negócios em setembro;

DMA via provedor – R\$ 6,20 bilhões em 754.100 negócios, ante R\$ 6,23 bilhões em 776.921 negócios em setembro;

DMA via conexão direta – R\$ 1,42 bilhões em 76.863 negócios, ante R\$ 2,35 bilhões em 151.180 negócios em setembro; e

DMA via co-location – R\$ 28,22 bilhões em 4.945.687 negócios, ante R\$ 32,22 bilhões em 5.626.059 negócios em setembro.

** 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, 06 de novembro de 2012.

Eduardo Refinetti Guardia
Diretor Executivo Financeiro, Corporativo e de Relações com Investidores