

BM&FBOVESPA S.A. - BOLSA DE VALORES, MERCADORIAS E FUTUROS
CNPJ nº 09.346.601/0001-25
NIRE 35.300.351.452

COMUNICADO AO MERCADO

Balanço de Operações de Setembro

- Estoque de títulos do agronegócio registrados na BM&FBOVESPA totaliza R\$ 6,92 bilhões, ante R\$ 5,63 bilhões, no período anterior.
- O volume financeiro dos ETFs registra R\$ 1,42 bilhão.
- Mercado de opções de commodities salta de 41.561 contratos negociados para 53.167.

Segmento Bovespa

O volume financeiro total no segmento Bovespa atingiu R\$ 131.437.121.147,94, em setembro, ante R\$ 177.906.246.853,76, registrado em agosto de 2011. A média diária alcançou R\$ 6,25 bilhões em setembro, ante R\$ 7,73 bilhões no mês anterior.

O número total de negócios atingiu a marca de 13.551.487 em setembro. Em agosto, o número de negócios foi de 16.234.673. Já a média diária de negócios atingiu 645.309 em setembro, ante os 705.855, registrados em agosto de 2011.

Ações

As ações que registraram maior giro financeiro em setembro foram: Vale PNA, com R\$ 15,41 bilhões; Petrobras PN, com R\$ 7,72 bilhões; Itauunibanco PN, com R\$ 6,55 bilhões; OGX Petróleo ON, com R\$ 5,88 bilhões; e Vale ON, com R\$ 4,22 bilhões.

Índices

O Ibovespa encerrou setembro aos 52.324 pontos, com queda de 7,38%.

As ações que obtiveram as maiores altas do Ibovespa em setembro foram: Embraer ON (+17,26%); BR Mals Par ON (+8,23%); Ultrapar ON (+6,15%); Cielo ON (+4,90%); e Redecard ON (+4,49%). As maiores baixas foram: Hypermarchas ON (-33,73%); MRV ON (-28,13%); Rossi Resid ON (-28,03%); Gafisa ON (-27,82%); e Brasken PNA (-22,86%).

Em setembro, os demais índices calculados pela Bolsa apresentaram as seguintes performances: IBrX-50 (-5,09% a 7.558 pontos); IBrX-100 (-4,54% a 18.025 pontos); ISE (-2,81% a 1.858 pontos); Itel (-8,21% a 1.589 pontos); IEE (-1,36% a 27.810 pontos); INDX (-6,31% a 8.683 pontos); IVBX-2 (-6,68% a 5.296 pontos); IGC (-4,45% a 6.189 pontos); Itag (-4,22% a 7.904 pontos); Small Cap (-7,19% a 1.161 pontos); MidLarge Cap (-4,29% a 798 pontos); ICON (-6,14% a 1.498 pontos); IMOB (-14,13% a 734 pontos); IFNC (-2,40% a 3.066 pontos); ICO2 (-3,62% a 923 pontos); IGCT (-4,14% a 1.735 pontos); UTIL (-2,31% a 2.436 pontos); IDIV (-1,91% a 2.576 pontos); IMAT (-6,49% a 1.585 pontos); e IBRA (-4,56% a 1.655 pontos).

Valor de mercado

O valor de mercado (capitalização bursátil) das 377 empresas com ações negociadas na BM&FBOVESPA, ao final de setembro, foi de R\$ 2,14 trilhões. Em agosto, esse valor era de R\$ 2,23 trilhões, referente ao mesmo número de companhias.

Níveis diferenciados

Em setembro, as 182 empresas integrantes dos Níveis Diferenciados de Governança Corporativa da BM&FBOVESPA representavam 65,30% do valor de mercado, 83,99% do volume financeiro e 85,50% dos negócios realizados no mercado a vista. Ao final de agosto, eram 182 empresas, que representavam 65,32% do valor de mercado, 77,05% do volume financeiro, e 83,46% da quantidade de negócios.

Participação dos mercados

Em setembro, o mercado a vista (lote-padrão) respondeu por 93,4% do volume financeiro; seguido pelo de opções, com 5,2%; e pelo mercado a termo, com 1,4%. O After Market movimentou R\$ 950,49 milhões, com a realização de 67.300 negócios, ante R\$ 1,12 bilhão e 78.909 transações no mês anterior.



Participação dos investidores

Em setembro, os investidores institucionais lideraram a movimentação financeira no segmento Bovespa, com participação de 33,82%, ante 32,08% em agosto. Na segunda posição, ficaram os investidores estrangeiros, que obtiveram participação de 33,78%, ante 36,50%. As pessoas físicas movimentaram 22,95% ante 20,16%. As instituições financeiras ficaram com 7,66%, ante 9,73%; as empresas, com 1,75%, ante 1,47%; e o grupo Outros com 0,04%, ante 0,06% em agosto.

Investimento Estrangeiro

Em 2011, os investimentos estrangeiros nos papéis de empresas brasileiras até setembro atingiu volume positivo de R\$ 7.437.147.628,40, resultado de R\$ 7.797.276.175,40 (sendo 6,2 bilhões ofertadas no Brasil) em distribuições públicas e o saldo negativo de R\$ 360.128.547,00 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\$ 249.661.434,00, resultado de vendas no valor de R\$ 44.396.267.461,00 e de compras de ações de R\$ 44.146.606.027,00.

A participação dos estrangeiros nas ofertas públicas de ações, incluindo IPO's, representa 58,1% do total de R\$ 13.417.556.898,50 das operações realizadas com Anúncios de Encerramento publicados até 04 de outubro de 2011, conforme tabela disponível na sala de imprensa do site.

Clubes de investimento

Em setembro, foram abertos 25 novos clubes de investimento, totalizando 2.904 registros. Até o final de agosto, o patrimônio líquido era de R\$ 9,36 bilhões e o número de cotistas estava em 120.925, conforme os últimos dados disponíveis.

Investidores individuais

O número de contas de investidores pessoas físicas no mercado de ações foi de 593.311 em setembro. Ao final de agosto, o número era de 595.850.

ETFs

Os oito ETFs (*exchange traded funds*, na sigla em inglês) negociados na BM&FBOVESPA totalizaram 75.740 negócios, em setembro, ante 78.809 em agosto. O

volume financeiro registrou R\$ 1,42 bilhão, ante R\$ 1,40 bilhão em agosto. Destaque para o ETF BOVA11, que replica o Ibovespa, com volume financeiro de R\$ 1,32 bilhão e 73.009 negócios.

Empréstimos de ações

Em setembro, o número de operações com empréstimos de ações foi de 125.257, ante 141.721 em agosto. O volume financeiro totalizou R\$ 61,61 bilhões, em setembro, ante R\$ 62,63 bilhões no mês anterior.

Renda fixa privada

Em setembro, o volume financeiro do mercado secundário de renda fixa privada totalizou R\$ 28,50 milhões, ante R\$ 39,73 milhões em agosto, somados os negócios realizados no Bovespa Fix e Soma Fix. Deste total, R\$ 14,42 milhões foram referentes a debêntures e R\$ 14,08 milhões aos Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRI).

Fundos de Investimento Imobiliários

Os Fundos de Investimento Imobiliários (FIIs) movimentaram R\$ 77,95 milhões em 7.855 negócios, em setembro. No mês anterior, o volume financeiro registrado foi de R\$ 89,28 milhões, em 8.685 negócios. O mês de setembro encerrou com 61 fundos imobiliários registrados e autorizados a negociação nos mercados de bolsa e balcão da BM&FBOVESPA.

Segmento BM&F

Em setembro, os mercados do segmento BM&F totalizaram 59.365.524 contratos negociados e volume financeiro de R\$ 4,35 trilhões, ante 78.606.873 contratos e giro de R\$ 5,23 trilhões em agosto. A média diária de contratos negociados foi de 2.826.930 em setembro, ante 3.417.690 em agosto. Ao final do último pregão de setembro, o número dos contratos em aberto, no total do mercado, era de 36.620.797 posições, ante 37.821.302 em agosto.

Derivativos financeiros

Em setembro, o futuro de Juro (DI) contabilizou 32.142.429 contratos negociados, ante 43.131.174 em agosto. O Dólar Comercial futuro encerrou setembro com 9.193.043

contratos negociados, ante 8.674.297 no mês anterior. O futuro de Ibovespa registrou a negociação de 2.098.962 contratos, ante 3.022.720. O futuro de reais por Euro contabilizou 70.857 contratos negociados, ante 37.122.

Minicontratos

Em setembro, foram negociados 3.675.847 minicontratos derivativos, ante 4.163.031 em julho. O minicontrato de Ibovespa futuro negociou 3.350.581 contratos, ante 3.858.463. O minicontrato de Dólar Comercial futuro totalizou a negociação de 323.671 contratos, ante 303.044 em agosto. Os minicontratos futuros encerraram setembro com 34.672 posições em aberto, ante 38.741 no mês anterior.

Derivativos de commodities

Em setembro, foram negociados 231.055 contratos futuros e de opções sobre futuro de commodities, ante 252.193 em agosto. Ao final do período, foram registrados 148.035 contratos em aberto, ante 136.855 no mês anterior. As opções sobre futuro de commodities totalizaram 53.167 contratos, em setembro, ante 41.561 no período anterior.

Os novos derivativos de soja com liquidação financeira, lançados em janeiro, registraram a negociação de 15.944 contratos no mês de setembro, ante 14.528 no mês anterior. O número de contratos negociados de futuros e de opções de boi gordo foi de 116.410, em setembro, ante 124.299 em agosto. O milho fechou o período com total de 55.767 contratos, entre futuros e opções, ante 57.033 no mês anterior. O café arábica encerrou setembro com 36.407 contratos, enquanto em agosto o total foi de 47.632. O etanol hidratado registrou 6.527 contratos negociados, ante 8.701 em agosto.

Títulos do agronegócio

Em setembro, o estoque de títulos do agronegócio registrados na BM&FBOVESPA totalizou R\$ 6,92 bilhões, ante R\$ 5,63 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) registradas na Bolsa totalizou R\$ 5,68 bilhões, ante R\$ 4,27 bilhões, em agosto. O volume de CPRs (Cédula de Produto Rural) registradas somou R\$ 1,02 bilhão, contra R\$ 1,19 bilhão, no período anterior.



Ouro a vista

O mercado disponível de ouro (250 gramas) negociou, em setembro, 2.127 contratos, ante 2.656 em agosto. O volume financeiro totalizou R\$ 53,51 milhões no período, ante R\$ 61,54 milhões no mês anterior.

Dólar a vista

O dólar a vista (dólar pronto) totalizou 1.006 negócios com giro financeiro de US\$ 2,53 bilhões em setembro. No período anterior, foram registrados 976 negócios com volume financeiro de US\$ 2,39 bilhões. O volume total de dólares negociados no mercado interbancário brasileiro e registrados para liquidação na Clearing de Câmbio BM&FBOVESPA foi de 3.765 negócios e US\$ 48,36 bilhões, ante 4.037 negócios e US\$ 54,24 bilhões em agosto.

Participação dos investidores

Em setembro, as instituições financeiras lideraram a movimentação nos mercados do segmento BM&F, com participação de 34,52%, ante 31,86% em agosto. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que obtiveram 31,83%, ante 34,74% no mês anterior. Os investidores estrangeiros alcançaram 26,90%, ante 25,97%. As pessoas físicas encerraram o mês com participação de 4,81%, ante 5,13%; e as empresas, com 1,88%, ante 2,31%.

Investidores individuais

Ao final de setembro, a quantidade de investidores pessoas físicas com ao menos uma conta ativa na Clearing de Derivativos foi de 156.657 ante 152.954 no mês anterior.

Acesso direto ao mercado (DMA)

Segmento BM&F

Em setembro, as negociações realizadas via Acesso Direto ao Mercado (DMA, na sigla em inglês) no segmento BM&F* registraram 35.144.357 contratos negociados em 4.311.865 negócios. No mês anterior, o número de contratos negociados foi de 41.417.494, em 4.431.750 negócios.

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

DMA tradicional – 12.583.334 contratos negociados em 1.366.264 negócios, ante 17.540.231 contratos e 1.306.241 negócios em agosto;

DMA via provedor (incluindo o roteamento de ordens com o Sistema Globex) – 13.976.949 contratos negociados em 374.992 negócios, ante 14.088.756 contratos e 435.281 negócios em agosto;

DMA via conexão direta – 2.636 contratos negociados em 447 negócios, ante 4.210 contratos e 830 negócios em agosto; e

DMA via co-location – 8.581.438 contratos negociados em 2.570.162 negócios, ante 9.784.297 contratos e 2.689.398 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-GTS ou que acessam os mercados da Bolsa via co-location) totalizaram 4.685.186 contratos negociados, em 1.164.510 negócios. Em agosto, os totais foram 5.308.308 contratos negociados e 1.235.349 negócios.

Segmento BOVESPA

Em setembro, as negociações realizadas via DMA no segmento BOVESPA* totalizaram volume de R\$ 111,41 bilhões em 14.298.483 negócios. No mês anterior, o volume foi de R\$ 138,52 bilhões em 17.021.408 negócios.

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

DMA tradicional – R\$ 95,77 bilhões em 11.763.618 negócios, ante R\$ 120,45 bilhões e 14.098.638 negócios em agosto;

DMA via provedor – R\$ 1,34 bilhão em 177.044 negócios, ante R\$ 1,37 bilhão e 167.272 negócios em agosto; e

DMA via co-location – R\$ 14,29 bilhões em 2.357.270 negócios, ante R\$ 16,69 bilhões e 2.755.498 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, 06 de outubro de 2011.

Eduardo Refinetti Guardia
Diretor de Relações com Investidores