



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

BM&FBOVESPA divulga balanço de operações de fevereiro

- Segmento Bovespa estabelece recordes históricos de número de negócios total e média diária de negócios
- Negociação via Co-location no segmento Bovespa registra recordes históricos
- Empréstimo de ações bate recorde de número de negócios
- Etanol hidratado atingiu a marca recorde de contratos negociados
- ETFs registra recorde histórico de número de negócios e volume financeiro

Segmento Bovespa

Em fevereiro, o número de negócios atingiu a marca histórica de 10.897.755. O recorde anterior foi de 10.261.145 em maio de 2010. Em janeiro, foram realizados 9.304.931 negócios. A média diária de negócios atingiu o recorde de 544.888 em fevereiro, superando a marca de 511.041 em outubro de 2010. Em janeiro de 2011, a média diária foi de 465.247.

O segmento Bovespa movimentou em fevereiro, R\$ 145,67 bilhões, ante R\$ 129,49 bilhões registrados em janeiro. A média diária foi de R\$ 7,28 bilhões, ante R\$ 6,47 bilhões.

Ações

As ações que registraram maior giro financeiro em fevereiro foram: Petrobras PN, com R\$16,1 bilhões; Vale PNA, com R\$14,15 bilhões; OGX Petróleo ON, com R\$7,44 bilhões; Itauunibanco PN, com R\$5,64 bilhões; e Petrobras ON, com R\$4,23 bilhões.

Índices

O Ibovespa encerrou fevereiro aos 67.383 pontos, com alta de 1,21%.

As ações que obtiveram as maiores altas do Ibovespa em fevereiro foram: PORTX ON (+13,82%); LLX Log ON (+13,50%); OGX Petróleo ON (+13,02%); Eletrobras PNB

(+12,28%); e Petrobras ON (+8,49%). As maiores baixas em fevereiro foram: Cyrela Realt ON (-10,10%); B2W ON (-9,42%); Ecodiesel ON (-8,79%); GOL PN (-7,52%); e Fibria ON (-6,72%).

Em fevereiro, os demais índices calculados pela Bolsa apresentaram as seguintes performances: IBrX-50 (+2,14% a 9.482 pontos); IBrX-100 (+2% a 21.891 pontos); ISE (+1,57 a 2.105 pontos); Itel (+0,25% a 1.554 pontos); IEE (+2,66% a 28.124 pontos); INDX (-0,63% a 10.265 pontos); IVBX-2 (+0,39% a 5.830 pontos); IGC (+1,21% a 7.331 pontos); Itag (+2,01% a 9.352 pontos); Small Cap (+0,70% a 1.329 pontos); MidLarge Cap (+2,08% a 967 pontos); Iconsumo (+0,48% a 1.533 pontos); Imobiliário (-2,07% a 895 pontos); Ifinanceiro (+3,06% a 3.534 pontos); ICO2 (+1,10% a 1.060 pontos); e IGCT (+1,25% a 2.081 pontos).

Valor de mercado

O valor de mercado (capitalização bursátil) das 375 empresas com ações negociadas na BM&FBOVESPA, ao final de fevereiro, foi de R\$ 2,55 trilhões. Em janeiro, esse valor era de R\$ 2,47 trilhões, referente a 373 companhias.

Níveis diferenciados

Em fevereiro, as 172 empresas integrantes dos Níveis Diferenciados de Governança Corporativa da BM&FBOVESPA representavam 64,57% do valor de mercado, 76,17% do volume financeiro e 81,46% dos negócios realizados no mercado a vista. Ao final de janeiro, eram 168 empresas, que representavam 65,16% do valor de mercado, 77,28% do volume financeiro, e 80,20% da quantidade de negócios.

Participação dos mercados

Em fevereiro, o mercado a vista (lote-padrão) respondeu por 94% do volume financeiro; seguido pelo de opções, com 4%; e pelo mercado a termo, com 2%. O After Market movimentou R\$ 951,53 milhões, com a realização de 52.380 negócios, ante R\$ 1 bilhão e 56.834 transações no mês anterior.

Participação dos investidores

Em fevereiro, os investidores estrangeiros lideraram a movimentação financeira no segmento Bovespa, com participação de 34,05%, ante 34,76% em janeiro. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que obtiveram participação de 33,47%, ante 33,60%. As pessoas físicas movimentaram 22,38%, ante 21,76%. As instituições financeiras ficaram com 8,53%, ante 8,21%; as empresas, com 1,53%, ante 1,56%; e o grupo Outros com 0,04%, ante 0,11%.

Investimento Estrangeiro

Em 2011, os investimentos estrangeiros nos papéis de empresas brasileiras até fevereiro atingiu R\$ 36.659.037,00, resultado de R\$ 819.643.420,00 (a totalidade ofertada no Brasil) em distribuições públicas e o saldo negativo de R\$ 782.984.383,00 na negociação no mercado secundário da BM&FBOVESPA.

No mês de fevereiro, o balanço da negociação dos investidores estrangeiros na BM&FBOVESPA foi negativo em R\$ 1.184.391.688, resultado de vendas no valor de R\$ 50.025.957.563,00 e de compras de ações de R\$ 48.841.565.875,00.

A participação dos estrangeiros nas ofertas públicas de ações, incluindo IPOs, representa 67,2 % do total de R\$ 1.220.506.527,00 das operações realizadas com Anúncios de Encerramento publicados até 02 de março de 2011, conforme tabela disponível na sala de imprensa do site.

Clubes de investimento

Em fevereiro, foram abertos 35 novos clubes de investimento, totalizando 3.008 registros. Ao final de janeiro, o patrimônio líquido era de R\$ 10,99 bilhões e o número de cotistas estava em 131.638, conforme os últimos dados disponíveis.

Investidores individuais

O número de contas de investidores pessoas físicas no mercado de ações foi de 600.341 em fevereiro. Ao final de janeiro, o número era de 603.512.

Home Broker

Em fevereiro, a média diária de negócios foi de 285.872, ante 245.000 no mês anterior. O número total de negócios realizados foi de 5.717.442, ante 4.899.995 em janeiro. O volume financeiro totalizou R\$ 45,03 bilhões, ante R\$ 37,96 bilhões em janeiro. A participação no número de negócios do segmento Bovespa foi de 26,23%, ante 26,33% em janeiro. O serviço foi oferecido por 68 corretoras, mesmo número do mês anterior.

ETFs

Os negócios com os ETFs BRAX11, CSMO11, MOBI11, BOVA11, SMAL11, MILA11 e PIBB11 atingiram no mês de fevereiro a marca histórica de 33.804 negócios, um crescimento de 76,8% em relação ao mês de janeiro, quando foram realizados 19.120 negócios. O recorde anterior, de 30.059, foi registrado em dezembro de 2010. O volume financeiro registrado, em fevereiro, pelos sete fundos de índices negociados na Bolsa também atingiu a marca histórica de R\$ 876,25 milhões, ante R\$ 717,92 milhões de janeiro. Destaque para o ETF BOVA11, que replica o índice Ibovespa, com volume financeiro de R\$ 779,91 milhões e 30.489 negócios. No mês de fevereiro também foi registrado recorde diário de número de negócios e volume financeiro de ETFs: foram 1.690 negócios, ante 1.431 de dezembro de 2010, com um giro médio financeiro de R\$43.812,7, ante R\$33.125,6 de dezembro de 2010.

Empréstimos de ações

Em fevereiro, o número de operações atingiu o recorde de 107.063, ante 98.352 em janeiro. O volume financeiro com empréstimos de ações foi de R\$ 48,37 bilhões, ante R\$ 59,05 bilhões em janeiro.

Renda Fixa

Em fevereiro, o volume financeiro do mercado secundário de renda fixa privada totalizou R\$ 6.705.880,73 milhões, ante R\$ 13,07 milhões em janeiro, somados os negócios no Bovespa Fix e Soma Fix. Deste total, R\$ 6.086.144,50 milhões foram referentes a debêntures e R\$ 619.736,23 milhões aos Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRI).

Segmento BM&F

Em fevereiro, os mercados do segmento BM&F totalizaram 56.375.869 contratos e volume financeiro de R\$ 3,39 trilhões, ante 53.040.432 contratos e giro de R\$ 3,97 trilhões em janeiro. A média diária de contratos negociados, em fevereiro, foi de 2.818.793, ante 2.525.735 em janeiro. Ao final do último pregão de fevereiro, o número dos contratos em aberto, no total do mercado, foi de 38.251.129 posições, ante 31.451.156 em janeiro.

Derivativos financeiros

Em fevereiro, o futuro de juro (DI) contabilizou 25.951.848 contratos negociados, ante 23.128.405 em janeiro. O dólar comercial futuro encerrou fevereiro com 5.087.373 contratos negociados, ante 5.451.925 no mês anterior. O futuro de Ibovespa apresentou 1.730.747 contratos, ante 1.109.490. O contrato futuro de reais por euro contabilizou 33.690 contratos negociados, ante 61.290.

Derivativos agropecuários

Em fevereiro, foram negociados 165.445 contratos agropecuários futuros e de opções, ante 157.202 em janeiro. Ao final de fevereiro, foram registrados 150.755 contratos em aberto, ante 132.483 no mês anterior.

O mercado futuro de etanol hidratado atingiu a marca histórica de 6.130 contratos negociados, ante o recorde de 5.486 contratos em dezembro de 2010. Em janeiro foram negociados 3.221 contratos. O número de contratos negociados de futuros e de opções de boi gordo foi 62.311, em fevereiro, ante 61.105 registrados em janeiro. O café arábica encerrou fevereiro com 43.706 contratos, enquanto em janeiro o total foi de 43.758. O milho fechou o período com total de 42.819 contratos, entre futuros e opções, ante 41.480 no mês anterior. No mesmo período, a soja registrou 9.824 contratos, ante 7.572.

Minicontratos

Em fevereiro, foram negociados 1.700.568 minicontratos derivativos, ante 1.242.623 em janeiro. O mercado futuro do Ibovespa negociou 1.583.452 minicontratos, ante 1.073.007. O dólar comercial futuro totalizou a negociação de 114.737 minicontratos, ante 167.211 em janeiro. Os minicontratos futuros encerraram fevereiro com 22.113 posições em aberto, ante 35.121 no mês anterior.

Ouro a vista

O mercado disponível de ouro (250 gramas) negociou, em fevereiro, 766 contratos, ante 1.972 em janeiro. O volume financeiro totalizou R\$ 14,70 milhões em fevereiro, ante R\$ 38,06 milhões no mês anterior.

Participação dos investidores

Em fevereiro, as instituições financeiras lideraram a movimentação financeira nos mercados do segmento BM&F, com participação de 44,01%, ante 44,91% no mês anterior. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que obtiveram 31,44%, ante 31,08% em janeiro. No mesmo período, os investidores estrangeiros alcançaram 19,41%, ante 18,67%. As pessoas físicas encerraram o mês com participação de 3,47%, ante 3,55%; e as empresas, com 1,58%, ante 1,72%.

Investidores individuais

Ao final de fevereiro, a quantidade de investidores pessoas físicas com ao menos uma conta ativa na Clearing de Derivativos foi de 157.436, ante 153.707 no ano anterior.

Acesso direto ao mercado (DMA)

Segmento Bovespa

Em fevereiro, o segmento Bovespa atingiu as marcas históricas de 697.943 negócios e volume financeiro de R\$ 4.221.936.000,00 por Acesso Direto ao Mercado (DMA, na sigla em inglês) via Co-location. Os recordes anteriores foram de 385.960 negócios e volume de R\$ 2.512.390.000,00 registrados em janeiro.

As negociações realizadas por roteamento de ordens via Acesso Direto ao Mercado (DMA, na sigla em inglês) ao segmento Bovespa* totalizaram volume de R\$ 112.414.576.000,00 em 11.604.668 negócios. No mês anterior, o volume foi de R\$ 91.942.424.000,00, em 9.333.021 negócios.

Os volumes negociados por tipo de acesso DMA ao segmento Bovespa foram:

DMA tradicional – R\$ 97.303.895.000,00, em 9.432.509 negócios, ante R\$ 79.533.918.000,00 e 7.685.165 negócios.

DMA via provedor – R\$ 857.324.000,00, em 54.236 negócios, ante R\$ 625.370.000,00 e 43.639 negócios.

Segmento BM&F

Em fevereiro, as negociações realizadas por roteamento de ordens via Acesso Direto ao Mercado (DMA, na sigla em inglês) no segmento BM&F* registraram 21.597.076 contratos negociados, em 2.659.274 negócios. No mês anterior, o número de contratos negociados foi de 16.404.063, em 1.570.297 negócios.

Os volumes negociados por tipo de acesso DMA ao segmento BM&F foram:

DMA tradicional – 8.150.916 contratos negociados, em 767.877 negócios, ante 7.021.351 contratos e 625.265 negócios em janeiro;

DMA via provedor (incluindo o roteamento de ordens com o Sistema Globex) – 9.527.734 contratos negociados, em 798.311 negócios, ante 7.143.359 contratos e 233.720 negócios em janeiro;

DMA via co-location – 3.230.548 contratos negociados, em 972.447 negócios, ante 2.239.353 contratos e 711.312 negócios em janeiro.

Em fevereiro, 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 2.176.264 contratos negociados, em 661.073 negócios. Em janeiro, os totais foram 1.629.694 contratos negociados e 506.651 negócios.



** O acesso direto aos sistemas de negociação da BM&FBOVESPA é realizado por DMA modelos 1, 2, 3 e 4. No modelo 1 ou tradicional, o cliente acessa o sistema GTS ou o Megabolsa por intermédio da estrutura tecnológica da corretora. No modelo 2 ou via provedor, ele não utiliza a estrutura anterior e se conecta aos sistemas por um provedor de acesso autorizado. No modelo 3, o acesso às plataformas de negociação da Bolsa ocorre via conexão direta. No modelo 4 ou via co-location, o cliente instala seu próprio computador dentro da Bolsa. O acesso via roteamento de ordens com o Globex, no segmento BM&F, é uma forma de DMA modelo 2.*

***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, 4 de março de 2011.

Eduardo Refinetti Guardia
Diretor de Relações com Investidores