

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

Balço de operaões de janeiro de 2012

- Total de negócios do segmento Bovespa registra segunda maior marca histórica.
- Estoque de títulos do agronegócio registrados na BM&FBOVESPA totaliza R\$ 9,85 bilhões, dos quais R\$ 8,40 bilhões são de LCAs.

Segmento Bovespa

O volume financeiro total no segmento Bovespa atingiu R\$ 132,26 bilhões, em janeiro, ante R\$ 130,68 bilhões, em dezembro de 2011. A média diária alcançou R\$ 6,29 bilhões, ante R\$ 6,22 bilhões no mês anterior.

O número total de negócios atingiu a marca de 14.674.699 em janeiro. É o segundo maior número registrado no segmento. Em dezembro, foi de 12.746.660. Já a média diária de negócios foi de 698.795, ante os 606.984, registrados em dezembro de 2011.

Ações

As ações que registraram maior giro financeiro em janeiro foram: VALE PNA, com R\$ 14,31 bilhões; PETROBRAS PN, com R\$ 11,87 bilhões; ITAUUNIBANCO PN, com R\$ 5,60 bilhões; OGX PETROLEO ON, com R\$ 5,26 bilhões; e VALE ON, com R\$ 3,89 bilhões.

Índices

O Ibovespa encerrou janeiro aos 63.072 pontos, com alta de 11,1 %.

As ações que obtiveram as maiores altas do Ibovespa em janeiro foram: CIA HERING ON (+29,39%), MRV ON (+25,70%), HYPERMARCAS ON (+24,94%), BROOKFIELD ON (+24,04%), MMX MINER ON (+23,09%). As maiores baixas foram: TELEMAR ON (-7,22%), MARFRIG ON (-6,09%), TELEF BRASIL PN (-5,23%), BR FOODS ON (-5,00%), AMBEV PN (-4,90%).

Em janeiro, os demais índices calculados pela Bolsa apresentaram as seguintes performances: IBrX-50 (+9,1% a 9.034 pontos); IBrX-100 (+7,9% a 21.267 pontos); ISE (+5,9% a 2.138 pontos); ITEL (-0,5% a 1.660 pontos); IEE (-0,6% a 32.415 pontos); INDX (+6,4% a 10.234 pontos); IVBX-2 (+7,1% a 6.170 pontos); IGC (+7,3% a 7.170 pontos); ITAG (+6,3% a 9.262 pontos); SMALL CAP (+8,2% a 1.299 pontos); MIDLARGE CAP (+7,8% a 946 pontos); ICON (+4,7% a 1.773 pontos); IMOB (+11,7% a 837 pontos); IFNC (+5,8% a 3.672 pontos); ICO2 (+5,8% a 1.085 pontos); IGCT (+7,4% a 2.017 pontos); UTIL (+1,6% a 2.987 pontos); IDIV (+5,2% a 3.081 pontos); IMAT (+14,5% a 1.823 pontos); e IBRA (+7,9% a 1.953 pontos).

Valor de mercado

O valor de mercado (capitalização bursátil) das 372 empresas com ações negociadas na BM&FBOVESPA, ao final de janeiro, foi de R\$ 2,44 trilhões. Em dezembro, esse valor era de R\$ 2,29 trilhões, referente a 373 companhias.

Níveis diferenciados

Em janeiro, as 181 empresas integrantes dos Níveis Diferenciados de Governança Corporativa da BM&FBOVESPA representavam 65,35% do valor de mercado, 80,29% do volume financeiro e 83,28% dos negócios realizados no mercado a vista. Ao final de dezembro, as 182 empresas representavam 64,87% do valor de mercado, 75,82% do volume financeiro, e 84,90% da quantidade de negócios.

Participação dos mercados

Em janeiro, o mercado a vista (lote-padrão) respondeu por 92,9% do volume financeiro; seguido pelo de opções, com 5,8%; e pelo mercado a termo, com 1,3%. O After Market movimentou R\$ 950,26 milhões, com a realização de 51.022 negócios, ante R\$ 887,60 milhões e 48.002 transações no mês anterior.

Participação dos investidores

Em janeiro, os investidores estrangeiros lideraram a movimentação financeira no segmento Bovespa, com participação de 37,35%, ante 39,07% em dezembro. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que tiveram participação de 33,45%, ante 32,20%. As pessoas físicas movimentaram 21,01% ante 17,99%. As instituições financeiras ficaram com 7,01%, ante 8,81%; as empresas, com 1,15%, ante 1,92%; e o grupo Outros com 0,03%, ante 0,01% em dezembro.

Investidores estrangeiros

No mês de janeiro, o balanço da negociação dos investidores estrangeiros na BM&FBOVESPA foi positivo em R\$ 7,17 bilhões, resultado de vendas no valor de R\$ 45,65 bilhões e de compras de ações de R\$ 52,82 bilhões.

Clubes de investimento

Em janeiro, foram abertos 08 novos clubes de investimento, totalizando 2.832 registros. Até o final de dezembro, o patrimônio líquido era de R\$ 9,02 bilhões e o número de cotistas estava em 115.866, conforme os últimos dados disponíveis.

Investidores individuais

O número de contas de investidores pessoas físicas no mercado de ações foi de 572.534 em janeiro. Ao final de dezembro, o número era de 583.202.

ETFs

Os doze ETFs (Exchange Traded Funds, na sigla em inglês) negociados na BM&FBOVESPA totalizaram 64.080 negócios, em janeiro, ante 74.438 em dezembro. O volume financeiro registrou R\$ 1,35 bilhão, ante R\$ 1,21 bilhão em dezembro.

Empréstimos de ações

Em janeiro, o número de operações com empréstimos de ações foi de 121.037, ante 121.897 em dezembro. O volume financeiro totalizou R\$ 68,34 bilhões, em janeiro, ante R\$ 84,76 bilhões no mês anterior.

Fundos de Investimento Imobiliário

Em janeiro, os Fundos de Investimento Imobiliário (FIIs) movimentaram R\$ 70,46 milhões em 9.038 negócios. No mês anterior, o volume financeiro registrado foi de R\$ 144,16 milhões, em 7.617 negócios. O mês de janeiro encerrou com 68 fundos imobiliários registrados e autorizados a negociação nos mercados de bolsa e balcão da BM&FBOVESPA.

Renda fixa privada

O mercado secundário de renda fixa privada da Bolsa totalizou R\$ 33,9 milhões, ante R\$ 14,4 milhões em dezembro, somados os negócios realizados no Bovespa Fix e Soma Fix. Deste total, R\$ 7,4 milhões foram referentes a debêntures e R\$ 24,5 milhões aos Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRI).

Segmento BM&F

Os mercados do segmento BM&F totalizaram 54.918.567 contratos negociados e volume financeiro de R\$ 4,40 trilhões em janeiro, ante 43.358.744 contratos e giro de R\$ 3,10 trilhões em dezembro. A média diária de contratos negociados, em janeiro, foi de 2.496.298, ante 2.064.702 no mês anterior. Ao final do último pregão de janeiro, o número dos contratos em aberto, no total do mercado, foi de 23.584.443 posições, ante 38.230.036 em dezembro.

Derivativos financeiros

O futuro de juro (DI) contabilizou 25.805.886 contratos negociados, ante 21.511.662 em dezembro. O dólar comercial futuro encerrou janeiro com 7.973.507 contratos negociados, ante 6.239.499 no mês anterior. O futuro de Ibovespa apresentou 1.566.899 contratos, ante 1.618.153. O futuro de reais por euro contabilizou 77.919 contratos negociados, ante 34.546.

Minicontratos

Em janeiro, foram negociados 2.655.360 minicontratos derivativos, ante 2.338.964 em dezembro. O mercado futuro do Ibovespa negociou 2.477.299 minicontratos, ante 2.172.318. O dólar comercial futuro totalizou negociação de 176.915 minicontratos, ante 164.136 em dezembro. Os minicontratos futuros encerraram janeiro com 33.690 posições em aberto, ante 14.852 no mês anterior.

Derivativos de commodities

Em janeiro, foram negociados 144.700 contratos futuros e de opções sobre futuro de commodities, ante 160.585 em dezembro. Ao final do período, foram registrados 146.288 contratos em aberto, ante 129.006 no mês anterior.

O número de contratos negociados de futuros e de opções de boi gordo foi de 55.138, em janeiro, ante 82.627 em dezembro. O milho fechou o período com total de 50.136 contratos, entre futuros e opções, ante 44.768 no mês anterior. O café arábica encerrou janeiro com 25.794 contratos, enquanto em dezembro o total foi de 23.106 contratos. O etanol hidratado registrou 9.174 contratos negociados, ante 6.774 contratos. A soja registrou negociação de 4.458 contratos em janeiro, ante 3.310 no mês anterior.

Títulos do agronegócio

O estoque de títulos do agronegócio registrados na BM&FBOVESPA totalizou R\$ 9,85 bilhões, ante R\$ 8,68 bilhões, em dezembro, 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\$ 8,40 bilhões, ante R\$ 7,46 bilhões, em dezembro.

Ouro a vista

O mercado disponível de ouro (250 gramas) negociou 420 contratos, ante 749 em dezembro. O volume financeiro totalizou R\$ 9,94 milhões em janeiro, ante R\$ 18,03 milhões no mês anterior.

Dólar a vista

O dólar a vista (dólar pronto) totalizou 1.271 negócios, com giro financeiro de US\$ 3,20 bilhões, em janeiro. No período anterior foram registrados 1.547 negócios, com volume financeiro de US\$ 2,07 bilhões. O volume de dólares negociados no mercado interbancário e registrados na Clearing de Câmbio da Bolsa, em janeiro, foi de US\$ 60,05 bilhões e 3.893 negócios, ante US\$ 40,62 bilhões, com 2.711 negócios, em dezembro.

Renda fixa pública

O volume financeiro do mercado secundário de renda fixa pública na BM&FBOVESPA, em janeiro, foi de R\$ 15,97 bilhões, ante R\$ 18,60 bilhões, em dezembro, somando-se todas as operações realizadas no Sisbex. Deste total, R\$ 44 milhões são referentes a operações definitivas e R\$ 15,93 bilhões a operações compromissadas.

Participação dos investidores

As instituições financeiras lideraram a movimentação financeira nos mercados do segmento BM&F em janeiro, com participação de 38,53%, ante 38,08% em dezembro. Na segunda posição, ficaram os investidores institucionais, que obtiveram 32,06%, ante 32,53% em dezembro. No mesmo período, os investidores estrangeiros alcançaram 23,18%, ante 23,04%. As pessoas físicas encerraram o mês com participação de 5,34%, ante 4,48%; e as empresas, com 0,90%, ante 1,83%, em dezembro.

Investidores individuais

Ao final de janeiro, a quantidade de investidores pessoas físicas com ao menos uma conta ativa na Clearing de Derivativos foi de 137.742, ante 135.256 no mês anterior.

DMA

Segmento BM&F

Em janeiro, as negociações realizadas via Acesso Direto ao Mercado (DMA, na sigla em inglês) no segmento BM&F* registraram 28.330.252 contratos negociados em 2.704.173 negócios. No mês anterior, o número de contratos negociados foi de 25.617.886, em 2.483.514 negócios.

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

DMA tradicional – 12.030.365 contratos negociados em 967.077 negócios, ante 12.266.856 contratos e 879.061 negócios em dezembro;

DMA via provedor (incluindo o roteamento de ordens com o Sistema Globex) –10.612.063 contratos negociados em 257.781 negócios, ante 8.225.628 contratos e 234.539 negócios em dezembro;

DMA via conexão direta – 948 contratos negociados em 264 negócios, ante 1.255 contratos e 303 negócios em dezembro; e

DMA via co-location – 5.686.876 contratos negociados em 1.479.051 negócios, ante 5.124.147 contratos e 1.369.611 negócios em dezembro.

Em janeiro, as operações 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 2.457.037 contratos negociados, em 583.293 negócios. Em dezembro, os totais foram 2.240.922 contratos negociados, em 537.582 negócios.

Segmento Bovespa

Em janeiro, as negociações realizadas via DMA no segmento BOVESPA* totalizaram volume de R\$ 99,71 bilhões em 14.391.091 negócios. No mês anterior, o volume foi de R\$ 86,68 bilhões em 12.297.326 negócios.

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

DMA tradicional – R\$ 85,11 bilhões, em 11.856.986 negócios, ante R\$ 71,67 bilhões, em 9.727.649 negócios em dezembro;

DMA via provedor – R\$ 1,29 bilhão em 181.892 negócios, ante R\$ 1,04 bilhão em 188.596 negócios em dezembro;

DMA via co-location – R\$ 13,21 bilhões em 2.337.128 negócios, ante R\$ 13,87 bilhões em 2.369.659 negócios em dezembro.

** 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, 8 de fevereiro de 2012.

Eduardo Refinetti Guardia

Diretor Executivo Financeiro, Corporativo e de Relações com Investidores