



07 de novembro de 2006
030/2006-DST

Revogado pelo Ofício Circular nº 047-2017-DP, de 18 de agosto de 2017

COMUNICADO EXTERNO

Membros de Compensação, Corretoras Associadas e Operadores Especiais


Ref.: Alteração de Leiaute do Arquivo “Cenário para Margem de Ativo Líquido”.

Informamos que, a partir de 24/11/2006, será alterado o leiaute do arquivo Cenário para Margem de Ativo Líquido, disponível na Internet no menu “Serviços\Download de Arquivos”, conforme leiaute anexo.

O objetivo dessa alteração é divulgar as informações “fator de ajuste” e “fatores de choque positivo e negativo”, utilizadas no cálculo de margem dos novos contratos de opções com ajuste no Subsistema de Margem para Ativos Líquidos.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Divisão de Helpdesk, pelo telefone (+11) 3119-2069.

Atenciosamente,


José Antônio Eirado Neto
Diretor de Sistemas e Tecnologia

Bolsa de Mercadorias & Futuros

Praça Antonio Prado, 48 01010-901 São Paulo, SP
Telefone (11) 3119-2000 Fax (11) 3107-9911
www.bmf.com.br bmf@bmf.com.br



Anexo ao Comunicado Externo 030/2006-DST

**SISTEMA DE RISCO BM&F
CENÁRIO PARA MARGEM DE ATIVO LÍQUIDO**

	Formato	Tamanho	Início	Fim	Observação
Tipo de registro	N	2	1	2	Fixo "01"
Separador	A	1	3	3	Fixo ".,"
Data de referência	N	8	4	12	"AAAAMMDD"
Separador	A	1	13	14	Fixo ".,"
Nome do arquivo	A	20	15	35	Fixo "CENLIQWEB.TXT"
Tipo de registro	N	2	1	2	Fixo "02"
Separador	A	1	3	3	Fixo ".,"
Código da primitiva	A	5	4	8	
Separador	A	1	9	9	Fixo ".,"
Vértice	N	5	10	14	
Separador	A	1	15	15	Fixo ".,"
Sinal	A	1	16	16	Fixo "+" ou "-"
Código cenário	N	5	17	21	
Separador	A	1	22	22	Fixo ".,"
Sinal	A	1	23	23	Fixo "+" ou "-"
Valor	N	13	24	36	7 decimais
Separador	A	1	37	37	Fixo ".,"
Sinal	A	1	38	38	Fixo "+" ou "-"
Fator de ajuste	N	9	39	47	4 decimais
Separador	A	1	48	48	Fixo ".,"
Sinal	A	1	49	49	Fixo "+" ou "-"
Fator de choque positivo	N	9	50	58	4 decimais
Separador	A	1	59	59	Fixo ".,"
Sinal	A	1	60	60	Fixo "+" ou "-"
Fator de choque negativo	N	9	61	69	4 decimais

Bolsa de Mercadorias & Futuros

Praça Antonio Prado, 48 01010-901 São Paulo, SP

Telefone (11) 3119-2000 Fax (11) 3107-9911

www.bmf.com.br bmf@bmf.com.br