

16 de fevereiro de 2012
021/2012-DO

COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da BM&FBOVESPA (BVMF) – Segmento BM&F

Ref.: **IOF/Títulos Incidente sobre Derivativos Financeiros (Decreto 7.563/2011) – Alterações no Relatório Analítico.**

Informamos que, a partir de **27/02/2012**, a BM&FBOVESPA disponibilizará detalhadamente os arquivos analíticos descritos no Comunicado Externo 057/2011-DO, de 02/12/2011, para melhor identificação e abertura de informações para a apuração da base de cálculo do IOF/Títulos Incidente Sobre Derivativos Financeiros.

O campo “Valor Delta” será expandido de três casas decimais para sete. Adicionalmente, serão disponibilizados dois novos campos, “ValorExposicaoPosicaoFinal” e “ValorExposicaoPassivaPosicaoFinal”, com informações relativas a cada operação, cujas consolidações finais estão refletidas nos Relatórios Sintéticos, nas colunas “Exposição Cambial Líquida d-1” e “Variação Exposição d-1 > d+0”, respectivamente. O novo leiaute encontra-se nos Anexos deste Comunicado.

Esclarecemos, ainda, que esse novo formato não terá efeito retroativo, de forma que apenas os arquivos disponibilizados a partir de **27/02/2012** possuirão essas alterações.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com as Diretorias de Registro e Liquidação, pelos telefones (11) 2565-5145/4140, e de Administração de Risco, pelos telefones (11) 2565-4263/7363/5166.

Atenciosamente,


Cicero Augusto Vieira Neto

Diretor Executivo de Operações, Clearing e Depositária

Anexo I ao Comunicado Externo XXX/2012-DO

Arquivo Analítico Pregão					
Descrição	Formato	Tamanho	Início	Fim	Observação
Tipo de Registro	N	002	001	002	Fixo "02"
Data	A	008	003	010	Data com formato AAAAMMDD
Entidade	A	003	011	013	Fixo "BVF"
Código do Membro de Compensação	N	008	014	021	
Código do Participante	N	008	022	029	
Código do Cliente	N	008	030	037	
Tipo de Pessoa	A	001	038	038	Tabela 1
Número do Documento do Cliente	N	019	039	057	
Mercado	A	003	058	060	Tabela 2
Mercadoria	A	003	061	063	
Serie	A	004	064	067	
Tipo de Opção	A	001	068	068	"C" – Call ou "P" - Put
Natureza – QA	A	001	069	069	"C" - Compra ou "V" - Venda
Quantidade – QA	N	017	070	086	2 decimais
Natureza – Q	A	001	087	087	"C" - Compra ou "V" - Venda
Quantidade – Q	N	017	088	104	2 decimais
Valor de Referência	N	017	105	121	2 decimais
Valor Taxa Base	N	019	122	140	4 decimais
Valor Delta	N	022	141	162	7 decimais
Valor Taxa de Juros Moeda Utilizada – Pré (%a.a.)	N	019	163	181	4 decimais
Valor do Cupom Cambial - (%a.a.)	N	019	182	200	4 decimais
Valor da Volatilidade - (%a.a.)	N	019	201	219	4 decimais
Valor do Ativo-objeto	N	018	220	237	3 decimais
Valor do Preço do Exercício Opção	N	018	238	255	3 decimais
ValorExposicaoPosicaoFinal	N	017	256	272	2 decimais
ValorExposicaoPassivaPosicaoFinal	N	017	273	289	2 decimais
Provisório/Definitivo	A	001	290	290	Tabela 3

Tabela 1 – Tipo de Pessoa

F – Pessoa física

J – Pessoa jurídica

C – CVM

Tabela 2 – Mercado

DIS - Disponível (à vista)

FUT- Futuro

OPD - Opção sobre Disponível

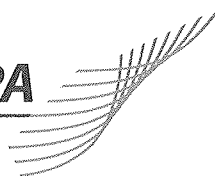
OPF - Opção sobre Futuro

TMO - Termo

Tabela 3 – Indicador de Provisório/Definitivo

P – Provisório

D – Definitivo



Anexo II ao Comunicado Externo XXX/2012-DO

Arquivo Analítico Balcão						
Descrição	Formato	Tamanho	Início	Fim	Observação	
Tipo de Registro	N	002	1	2	Fixo "02"	
Data	A	008	3	10	Data com formato AAAAMMDD	
Entidade	A	003	11	13	Fixo "BVF"	
Código do Membro de Compensação	N	008	14	21		
Código do Participante	N	008	22	29		
Código do Cliente	N	008	30	37		
Tipo de Pessoa	A	001	38	38	Tabela 1	
Número do Documento do Cliente	N	019	39	57		
Mercado	A	003	58	60	Tabela 2	
Mercadoria	A	003	61	63		
Numero do Contrato	N	022	64	85		
Código do Tipo de Opção	A	001	86	86	"C" – Call ou "P" – Put	
Natureza – QA	A	001	87	87	"C" - Compra ou "V" - Venda	
Quantidade – QA	N	017	88	104	2 decimais	
Natureza – Q	A	001	105	105	"C" - Compra ou "V" - Venda	
Quantidade – Q	N	017	106	122	2 decimais	
Valor de Referência	N	017	123	139	2 decimais	
Valor Taxa Base	N	019	140	158	4 decimais	
Valor Delta	N	022	159	180	7 decimais	
Valor Taxa de Juros Moeda Utilizada – Pré (%a.a.)	N	019	181	199	4 decimais	
Valor do Cupom Cambial (%a.a.)	N	019	200	218	4 decimais	
Valor da Volatilidade (%a.a.)	N	019	219	237	4 decimais	
Valor do Ativo-objeto	N	018	238	255	3 decimais	
Valor do Preço do Exercício da Opção	N	018	256	273	3 decimais	
Valor do Rebate	N	018	274	291	3 decimais	
ValorExposicaoPosicaoFinal	N	017	292	308	2 decimais	
ValorExposicaoPassivaPosicaoFinal	N	017	309	325	2 decimais	
Provisório/Definitivo	A	001	326	326	Tabela 3	

Tabela 1 – Tipo de Pessoa
F – Pessoa física
J – Pessoa jurídica
C – CVM
Tabela 2 – Mercado
SWA - Swap
OPC - Opções Flexíveis de Compra
OPV - Opções Flexíveis de Venda
TMO - Termo
Tabela 3 – Indicador de Provisório/Definitivo
P – Provisório
D – Definitivo

