



02 de setembro de 2011
018/2011-DO

COMUNICADO EXTERNO

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

Ref.: Sistema de Controle de Risco da Clearing de Derivativos – Nova Versão.

Informamos que, a partir de **19/09/2011**, será implantada nova versão do sistema de risco da Clearing de Derivativos da BM&FBOVESPA.

Esta versão baseia-se em arquitetura tecnológica que propicia expressiva melhoria de desempenho computacional, resultando em diminuição do tempo de resposta no processamento do cálculo de risco intradiário dos participantes e na simulação de valores de margem. Adicionalmente, foram acrescentadas novas funcionalidades que facilitam a utilização da ferramenta.

Por se tratar de modificação tecnológica, conceitos e metodologias de cálculo de margem não sofrerão alteração, exceto quanto ao último dia risco (implementado pelo Ofício Circular 091/2001-DG, de 13/07/2001), conceito que será desativado em virtude de sua substituição por procedimentos internos.

Para acessar o sistema, o usuário privilegiado do participante (Membro de Compensação, Corretora ou Participante de Liquidação Direta – PLD) deverá liberar as funcionalidades dos menus RI.D e RI.Q aos demais usuários.

Não haverá impacto para os usuários do serviço de consulta de risco via mensagem XML da Câmara de Derivativos (RI.N.3 – Consulta Risco Intradiário).

Informações e esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Administração de Risco, pelos telefones (11) 2565-4422/4139.

Atenciosamente,

Cícero Augusto Vieira Neto

Diretor Executivo de Operações, Clearing e Depositária