



17 de abril de 2008
010/2008-DI-DST

COMUNICADO EXTERNO

Revogado Pelo Comunicado Externo 034/2023-VNC, de 27 de abril de 2023

Membros de Compensação, Corretoras Membros e Operadores Especiais

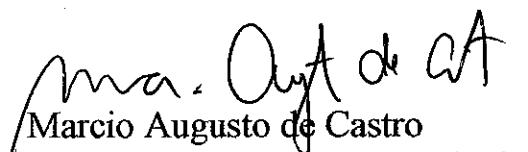
Ref.: Disponibilidade do Arquivo "Cenários de Margem para Ativos Líquidos".

Comunicamos que, a partir de 18/04/2008, estará disponível o novo leiaute do arquivo "Cenários de Margem para Ativos Líquidos", via Internet, no menu "Serviços\Download de Arquivos", conforme anexo.

A nova metodologia para geração de cenários de estresse para a volatilidade das opções padronizadas, publicada no Ofício Circular 031/2008-DG de 08/04/2008, será implementada no dia 25/04/2008.

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

Atenciosamente,


Marcio Augusto de Castro
Diretor de Sistemas e Tecnologia



Anexo ao Comunicado Externo 010/2008-DI-DST

SISTEMA RISCO LÍQUIDO

Cenário para Margem de Ativo Líquido

Descrição dos Campos	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	11	"AAAAMMDD"
Separador	A	1	12	12	Fixo ","
Nome do arquivo	A	13	13	25	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 do 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
Separador	A	1	70	70	Fixo ","
Tipo de choque	A	1	71	71	Fixo "N" = Não se aplica "M" = Multiplicativo "A" = Aditivo