



16 de março de 2006  
015/2006-DST

## COMUNICADO EXTERNO

Membros de Compensação, Corretoras Associadas e Operadores Especiais

Ref.: **Reunião sobre a Implantação do Novo Código de Negociação para Contratos Futuros e de Opções.**

Prezados Senhores,

Em atendimento aos diversos pedidos recebidos de participantes do mercado, convidamos a todos para reunião sobre a implantação do novo código de negociação para contratos futuros e de opções.

O evento, dirigido preferencialmente ao pessoal de tecnologia das instituições financeiras autorizadas a operar no mercado de derivativos, ocorrerá no dia 21/03/2006, às 16:00, no auditório da BM&F em São Paulo (Praça Antonio Prado, 48, 3º andar), e será transmitido para o auditório da Bolsa de Valores do Rio de Janeiro. Não é necessária inscrição.

A seguir, listamos as principais alterações que a implantação do novo código de negociação introduzirá e que poderão impactar os sistemas operacionais.

### Código dos Vencimentos e Séries

- **Mercado futuro:** o primeiro caractere identificará o mês de vencimento; os dois seguintes, o ano de vencimento; o quarto será deixado em "branco".
- **Mercado de opções:** aplicações que utilizam a numeração a seguir para identificação do tipo (*call/put*) e do modelo (americano/europeu) da opção:

De	Até	Tipo
01	25	Opção de compra sobre disponível
26	50	Opção de venda sobre disponível
51	62	Opção de compra sobre futuro europeia
63	75	Opção de compra sobre futuro americana
76	87	Opção de venda sobre futuro europeia
88	99	Opção de venda sobre futuro americana

- Para utilização do arquivo colocado à disposição na Extranet e na Internet:  
**PS / PR / D100 / 0199 – Contratos Cadastrados**  
– *Call/put* → Indicador de tipo de opção

**Bolsa de Mercadorias & Futuros**

Praça Antonio Prado, 48 – Telefone 3119-2000 – CEP 01010-901 – São Paulo – SP  
Caixa Postal 4275 – CEP 01061-970 – São Paulo – SP



- Americana e européia → Tipo de opção

### **Conversão**

- A Bolsa oferecerá arquivo de conversão ao mercado.
- Haverá conversão dos vencimentos, das séries e da mercadoria DI2 para DI1.
- Haverá conversão simultânea entre a Bolsa e os participantes.
- Exceção: os vencimentos da Estratégia de *Forward Points* com Futuro de Dólar Comercial (FRP) não serão convertidos.
- Principais conversões:
  - Contratos
  - Negócios (*after-hours*)
  - Especificação (*after-hours*)
  - Posição (carteira)

### **Séries Históricas**

- A consulta de séries históricas, após a alteração, poderá apresentar duas codificações (anterior e nova) simultaneamente, pois os dados históricos não serão convertidos.

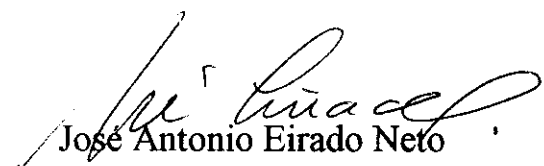
### **Implantação**

- Será realizada durante um final de semana.
- Todos os arquivos e relatórios resultantes do processamento da sexta-feira anterior à conversão estarão com o código antigo.
- O arquivo de conversão será colocado à disposição no sábado.
- Na segunda-feira, a negociação se dará com o novo código e todos os arquivos e relatórios oferecidos pela Bolsa o contemplarão.

Outras questões ou dúvidas referentes ao assunto poderão ser discutidas durante a reunião ora marcada.

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

Atenciosamente,

  
José Antonio Eirado Neto  
Diretor de Sistemas e Tecnologia