



07 de novembro de 2006  
029/2006-DST

## COMUNICADO EXTERNO

Membros de Compensação, Corretoras Associadas e Operadores Especiais


**Ref.: Novo Arquivo na Internet.**

Comunicamos que, a partir de 24/11/2006, estará disponível, no menu “Serviços\Download de Arquivos”, o arquivo Preços de Opções com Ajuste nos Cenários de Estresse de Margem para Ativos Líquidos, conforme leiaute anexo.

O objetivo desse arquivo é divulgar informações sobre os preços dos contratos de opções com ajuste nos cenários de estresse, usados no cálculo de margem de posições 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 029/2006-DST**

**SISTEMA DE RISCO LÍQUIDO**

	<b>Formato</b>	<b>Tamanho</b>	<b>Início</b>	<b>Fim</b>	<b>Observação</b>
Código da mercadoria	Char.	5	1	5	
Separador	Char.	1	5	6	“.”
Tipo de mercado	Char.	1	6	7	”
Separador	Char.	1	7	8	“.”
Série	Char.	4	8	12	”
Separador	Char.	1	12	13	“.”
Posição do cenário de preço	Numeric	3	13	16	positivo ou negativo
Separador	Char.	1	16	17	“.”
Posição do cenário de volatilidade	Numeric	3	17	20	positivo ou negativo
Separador	Char.	1	20	21	“.”
Posição do cenário de juros	Numeric	3	21	24	positivo ou negativo
Separador	Char.	1	24	25	“.”
Posição do cenário de carregamento	Numeric	3	25	28	Positivo ou negativo
Separador	Char.	1	28	29	“.”
Preço da opção com ajuste	Numeric	16	29	45	4 casas decimais
Separador	Char.	1	45	46	“.”
Preço da opção com ajuste e choque positivo	Numeric	16	46	62	4 casas decimais
Separador	Char.	1	62	63	“.”
Preço da opção com ajuste e choque negativo	Numeric	16	63	79	4 casas 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

