



06 de janeiro de 2004  
001/2004-DST

## COMUNICADO EXTERNO

Membros de Compensação, Corretoras Associadas e Operadores Especiais

Ref.: **Informações sobre a Taxa de Permanência.**

Prezados Senhores,

Comunicamos que, desde o pregão de 05/01/2004, as informações sobre a taxa de permanência podem ser assim obtidas:

### Relatórios

- RL/CF/A345/11 – Relatório Demonstrativo de Taxa de Permanência – Cliente Nacional;
- RL/CF/A345/21 – Relatório Demonstrativo de Taxa de Permanência – Cliente Estrangeiro;

### Arquivos

- PS/CF/T025/0199 – Lançamentos Financeiros por Data *Netting* (valores a serem cobrados em D+1);
- PS/CF/T025/0299 – Lançamentos Financeiros por Data de Geração (valores calculados no dia e informada a data de liquidação);
- PS/CB/M430/0199 – Valor dos Fatores  $p$  e Lambda – Pregão;
- PS/RT/M045/0199 – Valor dos Fatores  $p$  e Lambda por Faixa – *Swap*.

Nos arquivos de “lançamentos financeiros”, o código do lançamento da taxa de permanência é 91.

Atenciosamente,

  
José Antônio Eirado Neto  
Diretor de Sistemas e Tecnologia

**Bolsa de Mercadorias & Futuros**

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