



11 de agosto de 2006  
001/2006-DCD

## COMUNICADO EXTERNO

Corretoras Associadas

**Ref.: Extrato Mensal de Clientes – Incorporação de Novas Informações.**

Como é do conhecimento do mercado, a BM&F envia aos clientes das Corretoras, mensalmente, o “extrato mensal de operações”. Nesse relatório, constam as operações realizadas pelo cliente durante o mês de referência, por intermédio da Corretora, nos pregões de viva voz e eletrônico da BM&F, inclusive WebTrading.

A partir deste mês, o referido extrato incorporará informações relativas ao registro de operações no mercado de balcão, ou seja, contratos de *swap* e de opções flexíveis registrados em nome dos clientes das Corretoras.

Para conhecimento, segue anexo o encarte “entenda seu extrato de balcão”, que acompanhará o extrato mensal de operações a ser enviado aos clientes.

Por fim, aproveitamos para ressaltar que as Corretoras são responsáveis, perante a BM&F, pela comunicação dos dados cadastrais de seus clientes e pela atualização permanente desses dados. Nesse sentido, em caso de falhas no envio de extratos, a Bolsa entrará em contato com os intermediários responsáveis, para verificação do ocorrido e correção do problema, podendo tomar as providências que reputar necessárias.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com as Diretorias da Câmara de Derivativos (Cícero e Radislau) e de Auditoria e Compliance (Marcos Torres e Clara).

Atenciosamente,



Cícero Augusto Vieira Neto

Diretor da Câmara de Derivativos

**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



---

**Bolsa de Mercadorias & Futuros**

**Edifício-sede**

Praça Antonio Prado, 48  
01010-901 São Paulo, SP  
+11-3119-2000  
Fax +11-3107-9911  
bmf@bmf.com.br

**Escritório BM&F em Nova Iorque**

61 Broadway, 26th Floor, Suite 2605  
New York, NY 10006-2828 USA  
+1-212-750-4197  
Fax +1-212-750-4198  
bmfusainc@aol.com

**Escritório BM&F em Xangai**

200 Yincheng (M) Rd, Suite 404 Pudong New Area  
Shanghai 200120 China  
+86-21-5037-2886  
Fax +86-21-5037-2885  
bmfchina@bmfrepo.com.cn

**Internet**

[www.bmf.com.br](http://www.bmf.com.br)



**Entenda  
seu extrato  
de balcão**

# Entenda seu extrato de balcão

**Número de documento do cliente**  
 Nº doc : 00000000000000000000  
**Número da conta do cliente na Corretora**  
 Conta : 000000000000  
**Número e nome da Corretora**  
 Corretora : 000000 - xxxxxxxxxxxxxxxxx  
**Telefones de contato da Corretora**  
 Telefones : (00) 0000-0000  
**Nome do produto**  
 SWAP

CONTRATO					DATA		COMPRA				VENDA				
Data	Historico	Tipo	Numero	Valor-base	Base	Venc.to.	Ind. gar.	Variavel	Tipo	Perc.	Juros	Variavel	Tipo	Perc.	Juros
00/00/0000	NEGOCIO REGISTRADO	SDC	000.00000-0	0.000.000,00	00/00/0000	00/00/0000	C	DOL	T1		0,0000	DI1		101,0000	
Data de movimento	Situação do contrato	Código da combinação de variáveis	Número de contrato atribuído pelo sistema	Valor-base do contrato	Data-base do contrato	Data de vencimento do contrato	Indicador de garantia da Clearing: S – sem garantia C – com garantia	Código da variável de compra	Opção de referência para a variável de compra	Percentual atrelado à variável de compra	Juros atrelados à variável de compra	Código da variável de venda	Opção de referência para a variável de venda	Percentual atrelado à variável de venda	Juros atrelados à variável de venda

**Nome do produto**  
OPCAO FLEXIVEL

CONTRATO					DATA		COMPRA				VENDA				
Data	Historico	Tipo	Numero	Valor-base	Tipo opcao	Premio	Venc.to.	C/V	Variavel	Tipo	Premio	Ind. gar.	Preco exercicio	Barreira	Rebate
00/00/0000	NEGOCIO REGISTRADO	OFC	000.00000-0	0.000.000,00	A	00/00/0000	00/00/0000	C	DOL	T1	0,0001	C	2,1000	N	N
Data de movimento	Situação do contrato	Código da opção	Número de contrato atribuído pelo sistema	Valor-base do contrato	Tipo da opção: A – americana E – européia	Data de pagamento do prêmio	Data de vencimento do contrato	Compra ou venda	Código da variável	Opção de referência para a variável	Valor unitário do prêmio	Indicador de garantia da Clearing: S – sem garantia C – com garantia	Preço de exercício	Indicador de barreira: S – opção com barreira N – opção sem barreira	Indicador de rebate: S – opção com rebate N – opção sem rebate

**Posição em aberto no mercado de balcão**  
**POSICAO EM ABERTO NO ULTIMO DIA UTIL DO MES**

Contrato	Ind. gar.	Qtde. registros	Tamanho-base total
SDC - DI1 x DOL	C	00	00.000,00
Código do contrato de swap ou de opção flexível	Indicador de garantia da Clearing: S – sem garantia C – com garantia	Quantidade total de contratos registrados	Somatório do tamanho-base dos contratos

Obs.: para opção flexível de dólar, o tamanho-base é expresso em dólares  
 para opção flexível de índice (taxa de juro ou Ibovespa), o tamanho-base é expresso em quantidade de contratos  
 para swaps, o tamanho-base é expresso em reais