



31 de janeiro de 2005
003/2005-DST

COMUNICADO EXTERNO

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

Membros de Compensação, Corretoras Associadas e Operadores Especiais

Ref.: Disponibilidade do Arquivo “Volatilidade Implícita para Cálculo de Margem de Ativos Líquidos”.

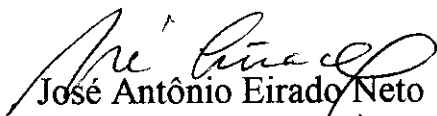
Prezados Senhores,

Comunicamos que, a partir de 09/02/2005, estará disponível o arquivo “Volatilidade Implícita para Cálculo de Margem de Ativos Líquidos”, via Internet, no menu “Serviços\Download de Arquivos”, conforme anexo.

Objetivo desse arquivo é demonstrar os valores das volatilidades empregadas no cálculo da margem das opções americanas sobre futuros da nova versão do Subsistema de Margem para Ativos Líquidos (SRL), conforme Ofícios Circulares 154/2004-DG, de 17/12/2004, e 013/2005-DG, de 27/01/2005.

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



Anexo ao Comunicado Externo 003/2005-DST

SISTEMA DE RISCO BM&F

Volatilidade Implícita para Cálculo de Margem de Ativos Líquidos

	Formato	Tamanho	Início	Fim	Observação
Código do FPR de Volatilidade	A	5	1	5	
Delimitador (“;”)	A	1	6	6	
Maturidade	A	5	7	11	Prazo em dias de saques
Delimitador (“;”)	A	1	12	12	
Preço de Exercício	N	15	13	27	13 inteiros e 2 decimais
Delimitador (“;”)	A	1	28	28	
Tipo de Opção	A	1	29	29	C – Call / P – Put
Delimitador (“;”)	A	1	30	30	
Valor da Volatilidade (percentual)	N	13	31	43	5 inteiros e 8 decimais

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