

27 de abril de 2023  
034/2023-VNC

## COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Revogação de Comunicados Externos relacionados a cálculo de margem de garantia e gestão de risco de contraparte central**

A B3 informa que, para melhorar e simplificar a forma de divulgação de orientações e regras para o mercado, revoga, a partir desta data, os Comunicados Externos listados no Anexo.

Os referidos Comunicados Externos referem-se a temas cujo objeto não é mais aplicável ou passaram a ser regidos pelos normativos da B3, tais como alterações nos modelos ou parâmetros de cálculo de margem de garantia; e assuntos pertinentes à gestão de risco de contraparte central que não estão atualmente vigentes.

Assim sendo, não há nenhuma alteração das regras ou procedimentos atualmente em vigor a partir dessas revogações, bem como qualquer impacto para os participantes do Listado B3.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Administração de Risco, pelos telefones (11) 2565-5031/5032.

Mario Palhares  
Vice-Presidente de Operações – Negociação Eletrônica e CCP

## Anexo do COMUNICADO EXTERNO 034/2023-VNC

### Lista de Comunicados Externos revogados

DOCUMENTO	DATA DE PUBLICAÇÃO	REFERÊNCIA
002-87-SGR	19/03/1987	Margem do Contrato Futuro de Frango
012-93-SOP	15/10/1993	Margem e Emolumentos dos Contratos a Termo de DI
007-95-SOP	07/06/1995	Divulgação das Taxas Teóricas para Cálculo de Margens de Swap e Opções Flexíveis
049-99-SGR	03/08/1999	Câmara Consultiva BM&F para Análise de Risco
052-99-SGR	02/09/1999	Sistema de Risco BM&F – Módulo II: Sistema de Cálculo de Margem para Swaps
133-99-SGR	08/09/1999	Sistema de Risco BM&F – Módulo II: Sistema de Cálculo de Margem para Swaps
001-2001-DST	11/05/2001	Arquivo dos Cenários Utilizados na Apuração da Margem de Garantia dos Ativos Líquidos
008-2002-DG	31/01/2002	Alteração do Fator de Margem Mínima de Swaps Cambiais
001-2005-DST	07/01/2005	Disponibilidade do Arquivo "Parâmetros de Cálculo de Margem para Ativos Líquidos"
003-2005-DST	31/01/2005	Disponibilidade do Arquivo "Volatilidade Implícita para Cálculo de Margem de Ativos Líquidos"
019-2005-DST	14/09/2005	Opções Padronizadas – Valor Base de Margem, Informação de Prêmio de Referência para Opções e Especificação de Travas
020-2005-DST	15/09/2005	Opções Padronizadas – Divulgação de Arquivos na Internet
109-2005-DG	01/12/2005	Sistema de Risco BM&F – Data de Implantação do Novo Módulo de Cálculo de Margem de Garantia para Opções Padronizadas sobre Disponível e Futuro
029-2005-DST	02/12/2005	Opções Padronizadas – Valor Base de Margem, Informação de Prêmio de Referência e Especificação de Travas

<b>DOCUMENTO</b>	<b>DATA DE PUBLICAÇÃO</b>	<b>REFERÊNCIA</b>
031-2006-DST	05/12/2006	Alteração do Leiaute do Arquivo Margem Requerida PS/TA/C020/0299
010-2008-DST	17/04/2008	Disponibilidade do Arquivo "Cenários de Margem para Ativos Líquidos"
027-2010-DO	24/06/2010	Alteração dos Códigos dos Fatores Primitivos de Risco (FPR) do Sistema de Risco Líquido da Clearing de Derivativos
015-2012-DO	27/01/2012	Opções Flexíveis – Extrato de Cálculo de Margem de Garantias