

PROJETOS E INICIATIVAS

2º SEMESTRE 2018

OPERAÇÕES ESTRUTURADAS DE VOLATILIDADE DE TAXA DE JURO FORWARD



CARACTERÍSTICAS

Objeto de Negociação	Contrato de Opção de Compra ou de Venda sobre Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia e dois vencimentos do Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (“Futuro de DI”), em uma proporção delta-hedge
Cotação	Prêmio da opção, em reais, com duas casas decimais
Preços de Exercício	Expresso em taxa de juro efetiva ao ano, base 252 dias úteis
Tick Size	R\$ 0,01
Código de Negociação	<p>VF1: refere-se à opção do tipo 1</p> <p>VF2: refere-se à opção do tipo 2</p> <p>VF3: refere-se à opção do tipo 3</p> <p>VF4: refere-se à opção do tipo 4</p> <p>VF5: refere-se à opção do tipo 5</p> <p>VF6: refere-se à opção do tipo 6</p> <p>VF7: refere-se à opção do tipo 7</p> <p>VF8: refere-se à opção do tipo 8</p> <p>VF9: refere-se à opção do tipo 9</p>
Meses de Vencimento	Os mesmos das opções

MENSAGENS, ARQUIVOS E FLUXOS OPERACIONAIS

Novo instrumento que será tratado da mesma forma que um de derivativo financeiro.

Não há alterações em mensagens, arquivos ou fluxos operacionais já aplicados aos demais derivativos financeiros.