

## Roteiro Exercício – Ajustes Diários

Mês	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez
Código	F	G	H	J	K	M	N	Q	U	V	X	Z

Entrar no site da BM&F Bovespa  
(<http://www.bmfbovespa.com.br/>):

- i. Ir para aba **Mercados** e entrar em **Dados Históricos**;
- ii. Entrar em Recuperar informações: selecionar resumo estatístico do pregão em seguida selecionar data e clique em **“Clique para selecionar”**;

**DADOS HISTÓRICOS – DERIVATIVOS**  
SISTEMA DE RECUPERAÇÃO DE INFORMAÇÕES

**BM&FBovespa**  
A Nova Bolsa

*Bem-vindo!*

Selecione o arquivo desejado para consultar:

Resumo estatístico do pregão

Selecione o período desejado:

De: 01/10/2015 Até: 08/10/2015

\* Período disponível para esta consulta:  
02/01/1990 a 08/10/2015

Clique para selecionar

© COPYRIGHT BM&FBovespa

iii. Selecione no quadro de Informações Disponíveis as informações que interessam e clique em **“Incluir Campo”**;

Você está vendo

Resultado da consulta

Resumo estatístico do preg

De: 01/10/2015

Até: 08/10/2015

Informações disponíveis

- Base de calculo de margem - Opções
- Contrato objeto da opção
- Contratos em aberto (Final)
- Contratos em aberto (Inicial)
- Cotação da última oferta de compra
- Cotação da última oferta de venda
- Cotação do ajuste - dia anterior

Incluir campo  Excluir campo  Incluir todos  Excluir todos

Informações selecionadas	Critérios da consulta	Ordem da consulta
Data do pregão *		Crescente <input type="button" value="⌵"/>
Referência do Resumo *		<input type="button" value="⌵"/>
Contratos negociados		<input type="button" value="⌵"/>
Cotação do ajuste - dia atual		<input type="button" value="⌵"/>
Cotação média		<input type="button" value="⌵"/>
Data do vencimento		<input type="button" value="⌵"/>
Maior cotação negociada		<input type="button" value="⌵"/>
Menor cotação negociada		<input type="button" value="⌵"/>
Mercado	<input type="button" value="Critérios"/>	<input type="button" value="⌵"/>
Mercadoria	<input type="button" value="Critérios"/>	<input type="button" value="⌵"/>

Selecione o formato do arquivo:

Microsoft Excel (\*.xlsx)

Para baixar esta consulta, insira seu e-mail no campo abaixo\*:

\* Campo obrigatório

SEU EMAIL AQUI

iv. Selecione crescente em **“Ordem da consulta”** para a **“Data do pregão \*”**;

v. Para **“Mercado”** vá em **“Critérios”** e selecione Igual > 2 – Futuro > Salvar ;

vi. Em **“Mercadoria”** vá em **“Critérios”** e selecione Igual > Escolha uma mercadoria;

vii. Coloque seu e-mail e clique em **“Enviar consulta”**;

viii. Fazer o download dos dados a partir do e-mail;

ix. Selecione uma data de vencimento para o contrato e fazer os cálculos sempre para a mesma data de vencimento e a mesma referência do resumo, usando as seguintes fórmulas:

Ajustes para o vendido	Ajustes para o comprado
$AD = -(PA_t - PO) \times \text{tamanho} \times n$ (1)	$AD = (PA_t - PO) \times \text{tamanho} \times n$ (1)
$AD = -(PA_t - PA_{t-1}) \times \text{tamanho} \times n$ (2)	$AD = (PA_t - PA_{t-1}) \times \text{tamanho} \times n$ (2)
$AD = (PA_{t-1} - PO) \times \text{tamanho} \times n$ (3)	$AD = -(PA_{t-1} - PO) \times \text{tamanho} \times n$ (3)
$AT = -(P_{\text{final}} - P_{\text{inicial}}) \times \text{tamanho} \times n$ (4)	$AT = (P_{\text{final}} - P_{\text{inicial}}) \times \text{tamanho} \times n$ (4)

x. Atentar para o tamanho do contrato, ele pode ser obtido no site da BM&F Bovespa pelo seguinte caminho: Mercados > Derivativos > Commodities > PRODUTO DESEJADO.

Por Vitor Bianchi Lanzetta