

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

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
Referência do Resumo *		
Contratos negociados		
Cotação do ajuste - dia atual		
Cotação média		
Data do vencimento		
Maior cotação negociada		
Menor cotação negociada		
Mercado	Critérios	
Mercadoria	Critérios	

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