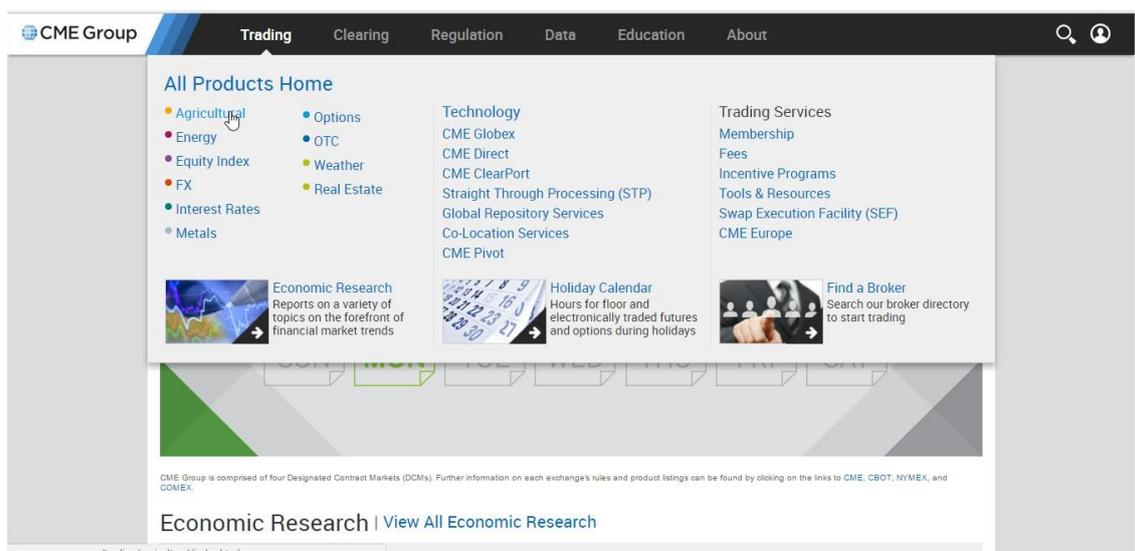


Roteiro Exercício – Ajustes Diários CME

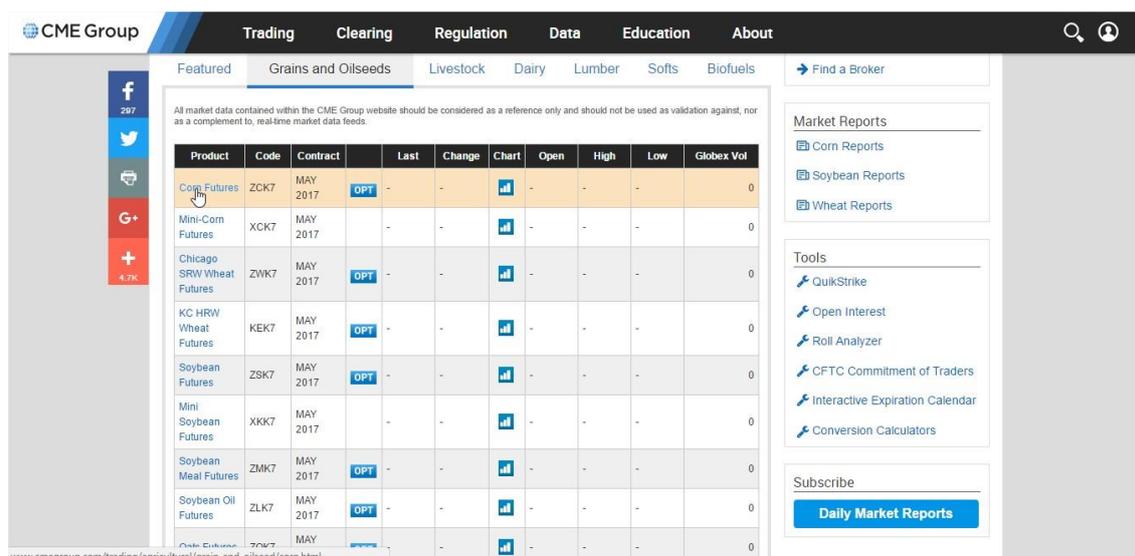
Mês	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez
Código	F	G	H	J	K	M	N	Q	U	V	X	Z

Entrar no site da CME Group (<http://www.cmegroup.com/>)

i. Ir para aba **Trading** e entrar em **Agricultural**



ii. Seleccione o produto desejado como no exemplo abaixo



iii. Em seguida, haverá na tela informações relativas aos valores de fechamento, abertura, alta, baixa e o preço de ajuste do dia

Market data is delayed by at least 10 minutes.

All market data contained within the CME Group website should be considered as a reference only and should not be used as validation against, nor as a complement to, real-time market data feeds. Settlement prices on instruments without open interest or volume are provided for web users only and are not published on Market Data Platform (MDP). These prices are not based on market activity.

Month	Options	Charts	Last	Change	Prior Settle	Open	High	Low	Volume	Hi / Low Limit	Updated
MAY 2017	OPT		361'4	+0'2	361'2	361'2	361'4	361'2	769	386'2 / 336'2	19:02:18 CT 21 Mar 2017
JUL 2017	OPT		369'0	+0'2	368'6	368'6	369'0	368'6	226	393'6 / 343'6	19:01:43 CT 21 Mar 2017
SEP 2017	OPT		376'4	+0'2	376'2	376'2	376'4	376'2	622	401'2 / 351'2	19:01:43 CT 21 Mar 2017
DEC 2017	OPT		384'6	+0'2	384'4	384'4	384'6	384'4	236	409'4 / 359'4	19:01:43 CT 21 Mar 2017
MAR 2018	OPT		394'0	0	394'0	393'6	394'0	393'6	3	419'0 / 369'0	19:00:30 CT 21 Mar 2017

iv. Ao clicar na aba **Settlements** é possível obter os preços de ajuste dos últimos 5 dias;

Trading Clearing Regulation Data Education About

Corn Futures Settlements

View Another Product

Quotes Settlements Volume Time & Sales Contract Specs Margins Calendar

Futures Options

Trade Date: Tuesday, 21 Mar 2017 (Final)

All market data contained within the CME Group website should be considered as a reference only and should not be used as validation against, nor as a complement to, real-time market data feeds. Settlement prices on instruments without open interest or volume are provided for web users only and are not published on Market Data Platform (MDP). These prices are not based on market activity.

Month	Open	High	Low	Last	Change	Settle	Estimated Volume	Prior Day Open Interest
MAY 17	363'4	364'0	359'2	361'0	-2'2	361'2	143,182	607,480
JLY 17	371'0	371'6	366'6	368'0	-2'4	368'6	52,845	359,316
SEP 17	378'4	379'2	374'2	376'4	-2'2	376'2	23,979	157,569
DEC 17	386'0	387'2	382'6	384'0	-1'6	384'4	40,061	210,860
MAR 18	395'6	396'6	392'4	393'6	-2'0	394'0	2,949	41,223
MAY 18	399'4	401'2	397'4A	398'6B	-1'6	398'6	522	5,803
JLY 18	403'0	404'4B	400'6	402'2	-2'0	402'0	574	13,654
SEP 18	-	-	-	-	-2'0	395'4	0	1,867
					-1'6	396'4	248	15,945

ral/grain-and-oilseed/corn_quotes_settlements_futures.html

v. Os valores apresentados estão em bushel/saca no caso do milho e da soja, devendo-se realizar as conversões necessárias conforme a tabela a seguir.

Commodity	Transformar		Multiplicar pelo fator de conversão*
	De	Para	
Soja	Us\$/sc	Us\$¢/bu	45,36
	Us\$¢/bu	Us\$/t	36,7437
Milho	R\$/sc	Us\$¢/bu	42,335 / Taxa de câmbio
	Us\$¢/bu	Us\$/t	39,36825
Café	Us\$/sc	Us\$¢/lb	0,7560
	Us\$¢/lb	Us\$/t	22,0459
Açúcar	Us\$/sc	Us\$¢/lb	0,9072
	Us\$¢/lb	Us\$/long t	22,3969
Etanol	Us\$/m³	Us\$¢/gal	0,3785
Óleo de soja	US\$/gal		
	Us\$¢/lb	Us\$/t	22,0459
Farelo de soja	Us\$/short t	Us\$/t	1,102311

vi. Selecione uma data de vencimento para o contrato e faça 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)

vii. Atenção para o tamanho do contrato, ele pode ser obtido no site da CME Group em Trading > Agricultural > produto desejado > Contract Specs

Por Priscila de Oliveira