**SIMULAÇÃO DE OPERAÇÃO EM FUTUROS**

**Nome do Participante**:

**Natureza da Operação**: **Produto**:

**Tamanho do contrato**: **Vencimento do contrato**:

**Contratos Negociados**: **Preço Negociado por unidade:**

**Base média histórica: Preço objetivo:**

|  |  |
| --- | --- |
| **Ajustes para o vendido** | **Ajustes para o comprado** |
| AD=-(PAt - PO) x tamanho x n  AD = -(PAt - PAt-1) x tamanho x n  AD=(PAt-1-PO) x tamanho x n  AT = -(Pfinal-Pinicial) x tamanho x n | AD=(PAt - PO) x tamanho x n  AD = (PAt - PAt-1) x tamanho x n  AD=-(PAt-1-PO) x tamanho x n  AT= (Pfinal-Pinicial) x tamanho x n |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Data**  **(1)** | **Operação**  **(2)** | **Preço**  **Negociado/**  **unidade (3)** | **Preço**  **Ajuste (4)** | **Ajuste Total**  **(5)** | **Fluxo Caixa**  **(6)** |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

Preço compra/venda no físico: Ajuste total por unidade:

Resultado final:

Ficou melhor, pior do que previsto ? explique a razão

**SIMULAÇÃO DE OPERAÇÃO COM OPÇÕES SOBRE FUTUROS**

**Nome do Participante**:

**Exercicio 1**

Operação: ( ) compra Put ( ) compra Call

Preço de Exercicio: Premio pago:

Tamanho do contrato: Vencimento do contrato:

Quantidade de Opções compradas:

Base histórica:

|  |
| --- |
| Situação no encerramento da operação: |
| Preço futuro para contrato subjacente: |
| Valor intrínseco: |

Preço físico na cidade: Base encerramento:

Resultado= (preço venda + vi + premio pago) =

Ficou dentro do esperado (preço objetivo), discuta**:**

Exercicio 2

Operação: ( ) compra Put ( ) compra Call

Preço de Exercicio: Premio pago:

Tamanho do contrato: Vencimento do contrato:

Quantidade de Opções compradas:

Base histórica: Preço objetivo:

|  |
| --- |
| Situação no encerramento da operação: |
| Preço futuro para contrato subjacente: |
| Valor intrínseco: |

Preço físico na cidade: Base encerramento:

Resultado= (preço venda + vi + premio pago) =

Ficou dentro do esperado (preço objetivo), discuta: