



A **Calculadora de Opções** auxilia na análise probabilística no valor justo dos prêmios, ou seja olhando para o passado do papel.

Para incluir as opções, selecione o sinal de ” + “ e informe o código da opção.

Pode fazer ainda a pesquisa dos códigos através da Cadeia de Opções na Navegação Integrada.

**Essa opção não está disponível para utilização com link DDE no Excel.**

#### **Parâmetros utilizados:**

- Código do Ativo (Código Spot)
- Volatilidade histórica do Ativo (em base anual)
- Taxa de Juros (anual)

#### **O programa atualiza os campos:**

- Preço a vista da opção
- Prazo e valor para exercício da série
- Prêmio da opção de compra do modelo de B&S
- Volatilidade implícita (cálculo por aproximação usando B&S)
- Os indicadores da opção (“greeks” – derivadas do prêmios em várias dimensões: preço Spot, tempo de maturação, taxa de juros, etc).