

MANUAL DE APREÇAMENTO CONTRATOS DE OPÇÕES ANEXO PARÂMETROS MENSIS

ANEXO DE PARÂMETROS MENSIS

Tabela 1 – Parâmetro para as opções classificadas como líquidas. As opções das demais ações que não constam na tabela, são classificadas como ilíquidas.

Ação	Modelo Vencimento	Modelo de Superfície	Número Mínimo de Séries	Janela de Captura (Minutos)
ABEV3	CorradoSu	VLGarch	5	20
ALOS3	CorradoSu	VLGarch	5	60
ALPA4	CorradoSu	VLGarch	4	20
ARZZ3	CorradoSu	VLGarch	4	60
ASAI3	CorradoSu	VLGarch	5	20
AZUL4	CorradoSu	VLGarch	5	60
B3SA3	CorradoSu	VLGarch	5	30
BBAS3	CorradoSu	VLGarch	5	40
BBDC3	CorradoSu	VLGarch	5	60
BBDC4	CorradoSu	VLGarch	5	40
BBSE3	CorradoSu	VLGarch	5	60
BEEF3	CorradoSu	VLGarch	5	60
BHIA3	CorradoSu	VLGarch	5	60
BOVA11	CorradoSu	VLGarch	5	60
BOVV11	CorradoSu	VLGarch	4	60
BPAC11	CorradoSu	VLGarch	5	60
BPAN4	CorradoSu	VLGarch	4	60
BRAP4	CorradoSu	VLGarch	5	30
BRFS3	CorradoSu	VLGarch	5	60
BRKM5	CorradoSu	VLGarch	5	30
CASH3	CorradoSu	VLGarch	4	60
CCRO3	CorradoSu	VLGarch	5	20
CIEL3	CorradoSu	VLGarch	5	60
CMIG4	CorradoSu	VLGarch	5	60
CMIN3	CorradoSu	VLGarch	5	60
COGN3	CorradoSu	VLGarch	5	60
CPFE3	CorradoSu	VLGarch	4	60
CPLE6	CorradoSu	VLGarch	5	60
CRFB3	CorradoSu	VLGarch	4	60
CSAN3	CorradoSu	VLGarch	5	60
CSNA3	CorradoSu	VLGarch	5	20
CVCB3	CorradoSu	VLGarch	5	60
CYRE3	CorradoSu	VLGarch	5	60
DXCO3	CorradoSu	VLGarch	4	60

ECOR3	CorradoSu	VLGarch	5	60
EGIE3	CorradoSu	VLGarch	5	60
ELET3	CorradoSu	VLGarch	5	60
ELET6	CorradoSu	VLGarch	5	60
EMBR3	CorradoSu	VLGarch	5	60
ENEV3	CorradoSu	VLGarch	5	60
ENGI11	CorradoSu	VLGarch	5	60
EQTL3	CorradoSu	VLGarch	5	30
EZTC3	CorradoSu	VLGarch	4	60
FLRY3	CorradoSu	VLGarch	4	60
GFSA3	CorradoSu	VLGarch	3	60
GGBR4	CorradoSu	VLGarch	5	20
GOAU4	CorradoSu	VLGarch	5	30

Ação	Modelo Vencimento	Modelo de Superfície	Número Mínimo de Séries	Janela de Captura (Minutos)
GOLL4	CorradoSu	VLGarch	4	60
HAPV3	CorradoSu	VLGarch	4	60
HYPE3	CorradoSu	VLGarch	5	60
IBOV11	SABR	VLGarch	5	20
IGTI11	CorradoSu	VLGarch	5	60
IRBR3	CorradoSu	VLGarch	3	60
ITSA4	CorradoSu	VLGarch	5	60
ITUB4	CorradoSu	VLGarch	5	40
JBSS3	CorradoSu	VLGarch	5	60
JHSF3	CorradoSu	VLGarch	4	60
KLBN11	CorradoSu	VLGarch	5	60
LREN3	CorradoSu	VLGarch	5	60
LWSA3	CorradoSu	VLGarch	4	60
MGLU3	CorradoSu	VLGarch	4	20
MRFG3	CorradoSu	VLGarch	5	60
MRVE3	CorradoSu	VLGarch	5	60
MULT3	CorradoSu	VLGarch	4	60
NTCO3	CorradoSu	VLGarch	5	60
PCAR3	CorradoSu	VLGarch	4	60
PETR3	CorradoSu	VLGarch	5	30
PETR4	CorradoSu	VLGarch	5	30
PETZ3	CorradoSu	VLGarch	5	60
POSI3	CorradoSu	VLGarch	4	60
PRI03	CorradoSu	VLGarch	5	60
QUAL3	CorradoSu	VLGarch	4	60
RADL3	CorradoSu	VLGarch	5	60

RAIL3	CorradoSu	VLGarch	5	60
RAIZ4	CorradoSu	VLGarch	5	60
RDOR3	CorradoSu	VLGarch	5	60
RENT3	CorradoSu	VLGarch	5	60
RRRP3	CorradoSu	VLGarch	5	60
SANB11	CorradoSu	VLGarch	5	60
SBSP3	CorradoSu	VLGarch	4	60
SLCE3	CorradoSu	VLGarch	4	60
SMAL11	CorradoSu	VLGarch	5	20
SMT03	CorradoSu	VLGarch	5	60
SOMA3	CorradoSu	VLGarch	4	60
SUZB3	CorradoSu	VLGarch	5	60
TAE11	CorradoSu	VLGarch	5	60
TIMS3	CorradoSu	VLGarch	5	60
TOTS3	CorradoSu	VLGarch	5	60
UGPA3	CorradoSu	VLGarch	5	60
USIM5	CorradoSu	VLGarch	5	60
VALE3	CorradoSu	VLGarch	5	60
VBBR3	CorradoSu	VLGarch	5	60
VIVT3	CorradoSu	VLGarch	4	60
WEGE3	CorradoSu	VLGarch	5	60
YDUQ3	CorradoSu	VLGarch	5	60

Tabela 2 – Parâmetros de agrupamento para as opções classificadas como líquidas

Ação	S _n	S _q	IC	α	α _n	α _q	α _{nq}
IBOV11	1	1	0,99	0,5	0,5	0,5	0,75
Demais Ações	0,005	0,005	0,99	0,5	0,5	0,5	0,75

Tabela 3 – Parâmetros para precificação de Opções de COPOM no call de fechamento

Contrato	Spread Máximo (bps)	Quantidade Contratos	Tempo de Exposição no Call
1º vencimento	6	10	30 segundos
Demais Vencimentos	10	10	30 segundos