

## Preço de uma Opção por Simulação de Monte-Carlo

Parâmetros	
preço do ativo	50
preço de exercício	50
taxa de juros anual	15%
volatilidade anual	30%
vencimento em anos	0.0833

Simulação	
no. Simulações	500
pontos da trajetória	50

Resultados		
	Call	Put
Black-Scholes	#VALUE!	#VALUE!
Monte-Carlo	2.0681	1.4229
IC inferior	2.0117	1.3801
IC superior	2.1245	1.4658
% erro	#VALUE!	#VALUE!

Pronto

Esta versão da planilha, que tem o código aberto para fins educacionais não visa a eficiência computacional, e sim a melhor forma didática de apresentação de solução do problema. Fica como desafio aos interessados acelerar o seu desempenho, que pode ser melhorado algumas vezes.

Esta planilha está disponível no site <http://www.risktech.com.br>, na seção Modelos de Excel, e dedica-se exclusivamente a fins educacionais. Nem o Risktech.com.br nem o Ibmecc, nem seus patrocinadores se responsabilizam por outros usos.

Luiz Alvares  
[lalvares@risktech.com.br](mailto:lalvares@risktech.com.br)