

Fórmula de Black-Scholes

Parâmetros	
preço do ativo	100
preço de exercício	100
volatilidade	40%
taxa de juros	15%
vencimento em anos	0.0833
dividendos contínuos	0
tipo	call

Preço Black-Scholes	###
----------------------------	-----

Preço Mercado	5.0000
Volatilidade Implícita	###

Volatilidade Fornecida		
	analítico	numérico
delta	#VALUE!	#VALUE!
gama	#VALUE!	#VALUE!
vega	#VALUE!	#VALUE!
theta	#VALUE!	#VALUE!
rho	#VALUE!	#VALUE!

Volatilidade Implícita		
	analítico	numérico
delta	#VALUE!	#VALUE!
gama	#VALUE!	#VALUE!
vega	#VALUE!	#VALUE!
theta	#VALUE!	#VALUE!
rho	#VALUE!	#VALUE!

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 lbmec, nem seus patrocinadores se responsabilizam por outros usos.

Luiz Alvares
lavares@risktech.com.br