



Transações	Descrição
1 Long Short	compra de um papel e venda de outro satisfazendo condição de RATIO desejado (preço de um dividido pelo preço de outro)
2 Compra ou Venda de VOL	compra de opção e venda de papel ou vice-versa que satisfaçam o valor da volatilidade implícita desejada conforme fórmula de B&S
3 Diferencial de Spread	compra de um papel e venda de outro satisfazendo spread calculado pelas proporções da operação
4 Diferencial de Preço	compra de um papel e venda de outro satisfazendo diferença de preços executados entre um e outro
5 Diferencial de VOLs	compra de opção e venda de um papel juntamente com venda de opção e compra de um outro papel de forma que a diferença das volatilidades implícitas conforme fórmula de B&S satisfaçam condição de valor desejado
6 SKEW	Compra/venda de uma opção, venda/compra de outra juntamente com a compra ou venda do delta no papel de acordo com um diferencial de volatilidades desejado. A operação pode ser feita também na forma de vega neutra com quantidades diferentes das opções
7 Borboleta	compra e venda de borboleta executando as 3 pernas da operação conforme spread desejado
8 Condor	compra e venda de condor executando as 4 pernas da operação conforme spread desejado.
9 Cash & Carry	Planilha de apoio a execução da arbitragem entre o índice futuro e o índice a vista (todos os papéis do índice).
10 VWAP	compra ou venda de papel ao longo de um período utilizando como benchmark o valor médio do papel ponderado pelo volume
11 TWAP	compra ou venda de papel ao longo de um período utilizando como benchmark o valor médio do papel ponderado pelo tempo

MrSpread® Consultoria
Rua Helena, 335 – CJ 82 – 04552-050 – Vila Olímpia – São Paulo – SP - Brasil
mrsread@mrsread.com.br
+55-11-3044-2126