



Formação Dólar





Formação
Dólar

4º PILAR

ESTRATÉGIAS OPERACIONAIS





Formação
Dólar

MÓDULO 10

ANALISANDO INDICADORES



Sumário

Módulo 10 - Analisando Indicadores	03
• Introdução - Módulo 10	03
• Aula 1 - Identificando Confluências	03
• Aula 2 - Smart Money Capital – SMC	04
• Aula 3 - Aplicando SMC no gráfico	05
• Aula 4 - Fibonacci	05
• Aula 5 - Frequência Matemática	05
• Aula 6 - Regiões de Liquidez	07

M10

Módulo 10

Analizando Indicadores

Introdução - Módulo 10

Este módulo é fundamental para os traders que desejam aprimorar suas habilidades operacionais diárias. A capacidade de interpretar corretamente o mercado usando as confluências dos indicadores é essencial para minimizar riscos e maximizar retornos. As aulas são projetadas para proporcionar uma compreensão clara e aplicável dos conceitos, garantindo a passibilidade de implementar as estratégias aprendidas de forma efetiva.

Instruções

- Assistir às aulas com atenção para compreender integralmente cada indicador e sua aplicação.
- Participar ativamente das sessões de análise para praticar as técnicas ensinadas.
- Estar preparado para integrar as informações aprendidas em uma estratégia lógica de operações.

Aula 1 - Identificando Confluências

Esta aula se dedica a explorar confluências de indicadores técnicos para identificar as melhores operações no mercado. A aula detalhará o uso de diversas ferramentas analíticas em um contexto prático.

Esta aula se dedica a explorar confluências de indicadores técnicos para identificar as melhores operações no mercado. A aula detalhará o uso de diversas ferramentas analíticas em um contexto prático.

Introdução aos Indicadores Chave

Money Flow: Importante para entender as tendências de compra e venda baseadas em desvios.

Médias Móveis: Uso das médias de 5, 8, 13, 26, 81 e 200, diferenciando médias exponenciais e aritméticas.

VWAP: Instruções detalhadas sobre como configurar e interpretar a VAP diária e ancorada, além das VWAPs de D-1 e D-2.

Configuração dos Indicadores

Descrição de como ajustar e visualizar indicadores na plataforma, incluindo cores específicas para cada média móvel para facilitar a identificação.

Análise de Confluências

Detalhes sobre como combinar informações de diferentes indicadores para determinar pontos de entrada e saída no mercado.

M10

Módulo 10

Analizando Indicadores

Exemplos práticos mostrando como as médias móveis interagem com o Money Flow para prever movimentos de mercado.

Uso de VWAP para identificar zonas de preços importantes e como elas influenciam as decisões de trading.

Estudo de Caso Prático

Análise de uma operação específica, detalhando como os indicadores interagiram em uma sessão de trading.

Discussão sobre a importância de não operar em meio a blocos institucionais sem uma clara confluência de outros indicadores.

Metodologia de Ensino

Demonstração na plataforma de trading para visualizar a aplicação dos conceitos. Discussão sobre a configuração ideal da tela para análise, com recomendações para evitar sobrecarga de informações.

É importante utilizar confluências de indicadores para uma forte análise técnica e aprender a configurar e interpretar sinais de múltiplos indicadores para tomar decisões informadas de trading, minimizando riscos e maximizando potenciais recompensas.

Aula 2 - Smart Money Capital – SMC

A análise técnica "Smart Money Capital" identifica como os operadores institucionais influenciam o mercado financeiro, uma técnica validada após anos de experiência em tesouraria e reconhecimento técnico. Originada por Wyckoff, essa análise é essencial para o entendimento diário do mercado e foi detalhada em uma aula sobre confluências e o impacto dos juros na precificação do mercado.

Nesta aula, são inseridos os conceitos fundamentais como "Bos" (quebra de estrutura), "Chock" (mudança de caráter do mercado), "Indução" (como o player influencia o mercado), "Oferta e Demanda", "Acumulação e Distribuição", e as "três leis de Wyckoff", (Oferta e Demanda, Causa e Efeito, Esforço e Resultado), além do "Order Blocker".

O "Bos" é entendido como um rompimento de pivô, indicativo tanto em tendências de alta quanto de baixa, marcando um ponto de quebra na estrutura de mercado.

O conceito de "Chock" é explicado como um indicativo de reversão de tendência, quando o mercado deixa de fazer topos e fundos crescentes e inicia uma nova direção.

A "Indução" é descrita como a manipulação do mercado pelo player institucional para atrair varejistas a posicionamentos que eventualmente são contrários aos interesses destes, usando a dinâmica de stops e recompras para direcionar o mercado a seu favor.

A análise de "Oferta e Demanda" foca em identificar zonas onde o mercado tem potencial para reversão ou continuação de tendência baseado em acumulação (preparação para um movimento ascendente) e distribuição (preparação para um movimento descendente).

Módulo 10

Analizando Indicadores

A análise de "Oferta e Demanda" foca em identificar zonas onde o mercado tem potencial para reversão ou continuação de tendência baseado em acumulação (preparação para um movimento ascendente) e distribuição (preparação para um movimento descendente).

"Order Blocker" refere-se aos pontos onde ordens institucionais são colocadas, agindo como barreiras que podem reverter ou confirmar a direção do preço após um rompimento.

Essa metodologia detalha como esses conceitos são aplicados no gráfico, destacando a importância de compreender esses padrões e a dinâmica para operações mais seguras e estrategicamente fundamentadas no mercado financeiro.

Aula 3 - Aplicando SMC no gráfico

Esta aula identifica regiões de SMC (Smart Money Capital) diretamente no gráfico, enfatizando a importância de realizar uma pré-análise antes de operar.

O método diário de análise inclui estudos em diferentes escalas temporais: diário, 60 minutos, 15 minutos e 5 minutos.

Destaca-se o uso de uma lógica consistente para identificar Order Blocker e regiões de liquidez, independentemente do intervalo temporal do gráfico.

É importante ressaltar que os gráficos de tempo maiores são preferíveis para operações, pois oferecem mais informações e precisão nas regiões identificadas.

Acompanhe a explicação detalhada sobre como aplicar SMC no gráfico no vídeo desta aula.

Aula 4 - Fibonacci

O tema desta aula é sobre Fibonacci e quais são as regiões mais importantes e que se pode identificar ótimos trades.

Acompanhe a explicação detalhada sobre Fibonacci no vídeo desta aula.

Aula 5 - Frequência Matemática

Compreender a frequência com que o mercado opera durante o dia é essencial para realizar análises e operações eficazes. Utiliza-se uma adaptação do cálculo de Fibonacci para este fim, diferindo do uso tradicional da razão de Fibonacci. Em vez disso, aplica-se um intervalo de 0 a 100, calculando em incrementos de 10%, para analisar as variações diárias do mercado.

M10

Módulo 10

Analizando Indicadores

Para entender a matemática de um dia para o outro, é essencial conhecer a mínima e a máxima do dia anterior. Por exemplo, no gráfico do dólar:

- **Mínima do Dia Anterior:** 5.018
- **Máxima do Dia Anterior:** 5.072

Realizando um cálculo rápido entre esses dois valores:

- **Diferença entre máxima e mínima:** $5072 - 5018 = 54$ pontos.
- Dividindo 54 por 10 (100%), obtemos uma frequência provável de 5.4 pontos por cada 10% do intervalo.

Aplicação Prática no Gráfico

Com esses dados, pode-se interpretar a atividade do mercado em um dia subsequente:

- Se o mercado teve uma variação de 24 pontos entre 65 e 41, isso equivale a aproximadamente cinco frequências de 5.4 pontos.

Exemplo de Frequências no Gráfico de 2 Minutos

No gráfico de 2 minutos, ao marcar os movimentos do mercado:

- De 65 para 70,5, alcançamos uma frequência.
- De 70,5 para aproximadamente 76, marcamos outra frequência.
- A próxima frequência é de 76 para 81, cada segmento com cerca de 5.4 pontos.

Importância da Frequência Matemática

Esta abordagem permite entender como o mercado segue padrões baseados na volatilidade média do dia anterior. Esse conhecimento é vital para operações de scalper, onde capturamos distorções de juros e tentamos aproveitar cada frequência de cinco pontos. Se o mercado supera esses cinco pontos, há potencial para atingir uma nova frequência, proporcionando mais oportunidades de ganho.

A frequência de mercado, ligada à volatilidade do dia anterior entre a máxima e a mínima, é fundamental para calcular e prever a atividade de mercado diária para intraday. Este método oferece uma forte ferramenta para traders que buscam entender melhor as oscilações de mercado e maximizar suas estratégias de trading.

Aula 6 - Regiões de Liquidez

Identificar regiões de liquidez é essencial para a operação eficaz no mercado financeiro. Utilizando o Profit com a configuração do DOL FUT, a análise é realizada por meio da coloração no livro de ofertas, sem focar em players específicos.

Configuração do Livro de Ofertas

No Profit, a visualização é ajustada conforme segue:

- **Lote 4 (compra e venda):** cor vermelha
- **Lote 10 (compra e venda):** cor amarela
- **Lote 20 (compra e venda):** cor verde

Esta configuração é importante pois multiplica cada lote por cinco, que é o mínimo de negociação do dólar futuro. A identificação das regiões de liquidez é realizada observando onde grandes lotes estão aguardando no livro de ofertas, indicando regiões fortes de liquidez onde o mercado pode buscar atingir.

Dinâmica de Liquidez na Abertura do Mercado

A abertura do mercado é um momento crítico, pois muitos players ajustam seus riscos baseados nas atividades ocorridas durante a madrugada, especialmente em tesourarias internacionais.

Por exemplo:

Um gestor de tesouraria que pela manhã verifica uma posição cambial significativa pode necessitar ajustar essa posição baseada em atividades de outras tesourarias internacionais.

Supondo que uma tesouraria tenha uma posição comprada de 2000 contratos e, durante a noite, a matriz no exterior decide comprar mais 2000 contratos, totalizando 4000. Se a matriz decide não manter mais a posição na filial brasileira, o gestor local deve zerar os 2000 contratos comprados inicialmente. Essa operação geralmente acontece na abertura do mercado, gerando uma alta liquidez e volume de transações.

Importância das Regiões de Liquidez

As regiões de liquidez são fundamentais pois indicam onde os grandes players estão interessados em realizar negócios. Ordens significativas podem ser deixadas penduradas de um dia para o outro no livro de negociações da B3, fornecendo pistas importantes sobre as intenções dos players.

Operar nas regiões de liquidez requer um entendimento profundo sobre como e por que os players posicionam suas ordens nessas áreas. Essas regiões podem servir como pontos críticos para zerar posições ou para entender possíveis mudanças na direção do mercado. A liquidez e a volatilidade associadas a essas regiões são indicativos vitais que influenciam as decisões de trading diárias.