

FORMAÇÃO

TRADE

ALTA RENDA 2.0

3R e Position Size

FORMAÇÃO

TRADEUR
ALTA RENDA 2.0

Gerenciamento de Risco



O plano de gestão de risco deve ser elaborado - e finalizado - antes que você entre na operação.

É importante saber desde antes de sua entrada qual o tamanho da sua posição em função do risco que você vai correr.

Com a gestão de risco, o trader estabelece stop, tamanho de lote, e escolhe os melhores movimentos de acordo com seu Position Size.

Quando o gerenciamento é efetivo, nossos ganhos são muito maiores do que nossas perdas.

Position Size



Para calcular seu Position Size, você precisa entender primeiro alguns conceitos.

- Drawdown é o rebaixamento da sua conta: de acordo com o tamanho da sua conta, quanto você está disposto a perder no dia?
- O seu stop tem que ser técnico (ele precisa estar bem posicionado) e financeiro (ele deve estar de acordo com o risco que você está disposto a assumir). O que vai contribuir para que o stop seja tanto técnico quanto financeiro é a quantidade de contratos que você está operando.

Exemplo: Imagine que você entrou numa operação e o mercado está com tendência de alta. Então, você faz uma compra. Seu stop deve estar numa região de liquidez, protegida. Para fazer o cálculo, você deve pegar a distância do seu ponto de entrada até o seu stop (que foi de 100 pontos).

- Para quem está operando mini-índice, cada ponto é equivalente a 0,2 reais.
- Você está disposto a arriscar 250 reais.

Então:

$$\begin{aligned} P.S. &= 250,00 \div 100 \div 0,2 \\ P.S. &= 12,5 \end{aligned}$$



Fator de Lucro(3R)

Os primeiros conceitos que devemos analisar para fazer a gestão de risco são: o 3R, que é a razão do risco retorno, e o Fator de Lucro, que é quando você perde para cada coisa que você ganha (por exemplo, se o seu fator de lucro é de 2:1, quando você ganha, você recebe duas vezes; quando você perde, você perde uma vez). No mínimo, um fator de lucro tem que ser de 1:1.

Você deve entender, de acordo com seu relatório de performance, a sua taxa de acerto e estabelecer seu fator de lucro conforme o que achar melhor.

Alavancagem e Desalavancagem



A alavancagem financeira é uma estratégia na qual o investidor opera com valores acima do que possui em conta, tem como objetivo permitir que os investidores consigam movimentar altas somas de dinheiro a partir de valores disponíveis bastante reduzidos., o que potencializa as chances de obter maiores rentabilidades e, em contrapartida, de sofrer também maior prejuízo na negociação.

Uma alavanca serve para levantar objetos com menos esforço. O termo alavancar significa dar impulso.

Na aula anterior vimos quanto equivale um contrato de índice e de dólar dentro da operação, as corretoras exigem a margem mínima para tal alavancagem.

(\$150 por mini dólar e \$100 por mini índice)

Cabe a cada investidor, ter um bom planejamento estratégico e financeiro para operar.

Realizações Parciais e Realavancagem.



Realizar parte da posição quando atingir um alvo inicial estabelecido previamente em sua análise. Pode ser a realização de 50% ou 70% da posição inicial (número de contratos) e manter a posição restante para aproveitar um movimento mais amplo. Quando realizamos parte da posição por ter atingido o objetivo inicial, costumamos dizer que "o trade não dá mais errado".

Nunca deixe uma operação que tenha atingido seu objetivo inicial voltar a ter prejuízo, para isso depois da primeira parcial, move sua ordem stop para seu ponto de entrada..



A lógica da alavancagem e da desalavancagem é inicialmente matemática pura.

Se você compra 5 contratos por 5000

Para ter Lucro precisa vender mais caro, acima desse valor, você decide se vende 4 ou 3 ou 2, desses contratos por exemplo.

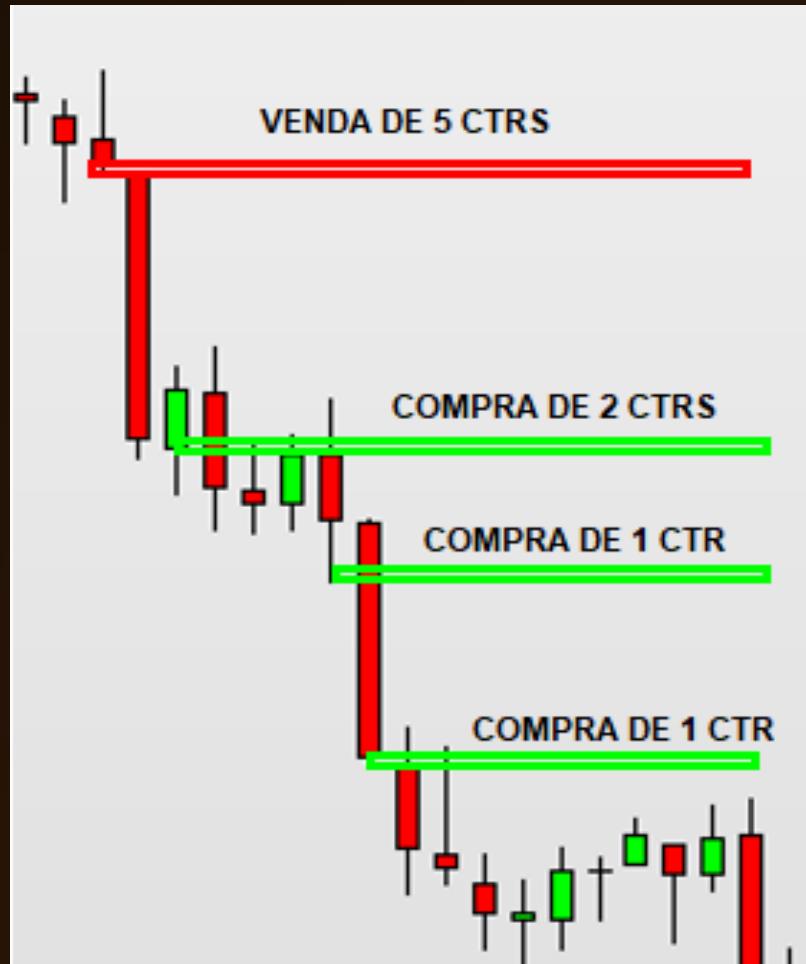
Se vender algo que comprou por 5000 por valor menor, você terá prejuízo.

No daytrade existe a possibilidade de vender antes de comprar.

Se você vende 5 contratos por 5000

Para ter Lucro precisa comprar mais barato , abaixo desse valor, você decide se compra 4 ou 3 ou 2, desses contratos por exemplo.

Se comprar algo que vendeu por 5000 por valor maior, você terá prejuízo.



Na ilustração ao lado, os preços estavam em queda, poderia fazer uma venda como a sugestão, depois comprar aos poucos , mantendo 1 contrato na operação para tentar levar mais abaixo seu encerramento.

O inverso se aplica ao mercado em alta.

OBS: Tenha muito cuidado ao enviar suas ordens, verifique se a quantidade está correta.

Tipos de Ordens:



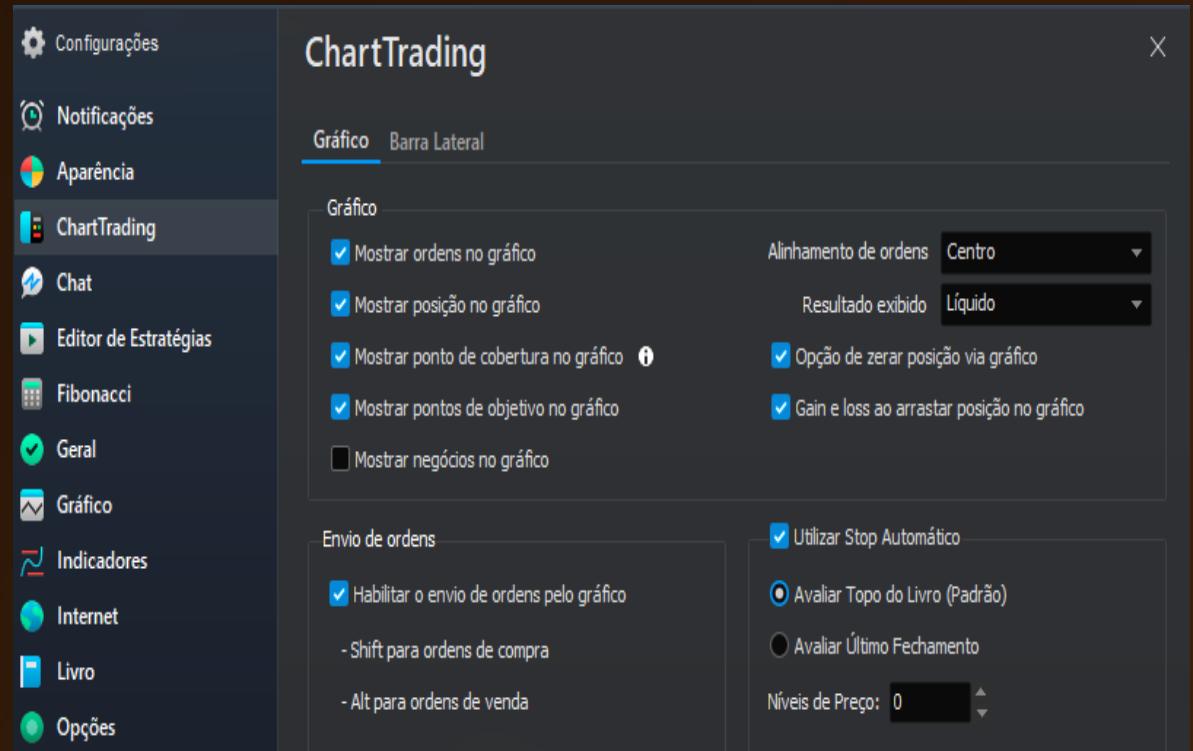
Ordem Limite (Trades Passivos)

- A ordem Limite é uma ordem que permite ao investidor definir a quantidade e o preço pelo qual deseja negociar. Sua ordem, seja de compra ou venda, só é executada quando o valor da moeda atingir o que você determinou.
- Quando apregoada (lançada), faz parte de uma fila de execução do Livro de Ofertas.
- A execução de ordens limites (passivas) desacelera o movimento ou dependendo da proporção em relação à contraparte, podem “frear” o movimento de tendência.

Ordem Limite (Trades Passivos)



- São enviadas pelo teclado





Ordem A Mercado (Agressões)

- Para que uma ordem limite (passiva à espera do preço) seja executada, tanto compra como venda, é preciso que a contraparte aceite o preço do ativo no tick exato que ela foi apregoada. A iniciativa, ou o aceite, chamamos de agressão.
- Se uma das partes (comprador ou vendedor) não tomar a iniciativa (agredir), não há negócio. Desta forma, para que haja negociações, é preciso que uma das partes faça operação a mercado (agressão).
- A execução de ordens a mercado (dinâmicas) em bom volume e de forma recorrente tem a capacidade de iniciar e/ou acelerar o movimento à medida que as ordens passivas se esgotam.

Ordem A Mercado (Agressões)



- São enviadas normalmente pelo charttrading



Ordem Stop



- Diferente das ordens limitadas, este tipo de ordem não entra no book de ofertas. Ou seja, não faz parte da fila de execução do Livro de Ofertas imediatamente.
- Quando o preço alcança as ordens Stop, elas são acionadas e entram à mercado, como um trade dinâmico.
- Ordem Stop para um trade de venda é uma ordem de Compra Stop.
- Ordem Stop para um trade de compra é uma ordem de Venda Stop.



PRINCÍPIOS vs. REGRAS

Lógica e bom senso – “não pergunte quantos pontos”

RISCO vs. OPORTUNIDADE

Trader profissional negocia risco baseado em análise técnica para identificar as melhores oportunidades a um risco calculado, que de forma sistemática, ao longo de blocos de operações, a estatística de acertos e o saldo financeiro sejam positivos e dentro das expectativas projetadas no seu plano.

FORMAÇÃO

TRADEUR
ALTA RENDA 2.0