

FORMAÇÃO

TRADER

ALTA RENDA 2.0

INTROÇÃO AO MERCADO FINANCEIRO

FORMAÇÃO
TRADER
ALTA RENDA 2.0



Derivativos e Contratos Futuros

FORMAÇÃO
TRADER
ALTA RENDA 2.0





Derivativos e contratos futuros

- Conceito de contratos derivados: são contratos que derivam a maior parte de seu valor de um ativo subjacente + a taxa de juros no período
- Os derivativos podem ser classificados em: contratos a termo, contratos futuros, opções de compra e venda, etc...



Contratos Futuros de Índice Ibovespa

- A Carteira teórica do Índice Bovespa = Ibovespa (portfólio de ações não negociável) o objetivo da carteira teórica é servir como reflexo do desempenho desses ativos.
- Um contrato futuro desta carteira permite ao investidor negociar a expectativa de preço futuro do mercado de ações sem precisar comprar as ações que compõem a carteira. Comprar um contrato futuro é o mesmo que comprar todas as ações que compõem o Índice.

- INDFUT (contrato cheio)
O tamanho do contrato é o valor do Ibovespa multiplicado R\$1,00
Para o operar o Índice futuro, o trader deve negociar em lotes de 5 contratos

Como o valor é muito alto para pessoa física, em 2001 a B3 inaugurou os mini contratos, o que vem popularizando o mercado

- WINFUT (mini contrato)
O tamanho do contrato é de 20% do contrato cheio (IND), ou R\$0,20 por ponto do Ibovespa
Quantidade mínima para operar é de 1 contrato



Contratos Futuros de Dólar

- No mercado de câmbio internacional, as moedas são analisadas e negociadas em pares.
- O dólar futuro é um contrato de compra ou venda da moeda comercial, baseado na taxa de câmbio da data atual e com vencimento definido
- Contratos Futuros de Dólar: usados como instrumentos de proteção (Hedge) e especulação sobre o valor da moeda americana em data futura.
- DOLFUT (contrato cheio)
O contrato futuro exige um mínimo de 5 contratos negociados (no valor de US\$ 50 mil cada um)

Como o valor é muito alto para pessoa física, em 2001 a B3 inaugurou os mini contratos, o que vem popularizando o mercado

- WDOFUT (mini contrato)
No mini dólar você pode negociar somente 1 contrato, no valor de US\$ 10 mil, ou seja, o tamanho do contrato é de 20% do contrato cheio (DOL).
Quantidade mínima para operar é de 1 contrato

Metodologia AAR



Na nossa abordagem educacional, entre outras análises rastreamos o mercado. Para que isso seja possível usamos os ativos históricos:

- **WINFUT e WDOFUT** nos tempos maiores do gráfico.

O motivo, é que esse contrato para ser operável existe um código para cada prazo de vencimento que mudam a cada 2 meses no caso do mini índice ou todo mês no caso do mini dólar. Logo ele não nos dá tempo hábil para uma análise macro.

FORMAÇÃO

TRADER

ALTA RENDA 2.0