

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7

ÍNDICES

1

Conteúdo desta aula:



Recapitulando a aula anterior



Índices



Resumo

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7

Índices

2

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7
Índices



ÍNDICES

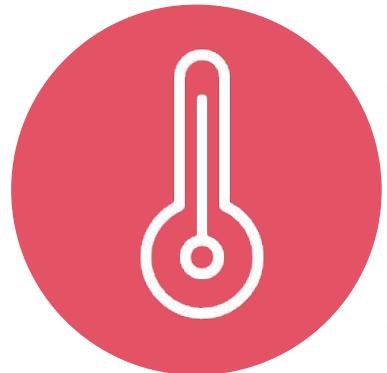
3

Índices

Bolsa de Valores

Ibovespa

Desde 02 de janeiro de 1968



**Termômetro
do Mercado**



MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7

Índices

4

Índices

Carteira Teórica IBOVESPA



Revisão a cada **4 meses**

Rebalanceamento

Saída e a entrada de empresas

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

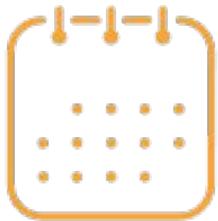
AULA 7

Índices

5

Índices

Critérios para participação
de empresas no **IBOVESPA**:



**últimos 12 meses em
85%
dos índices de
negociabilidade.**



Presença em
95%
Pregões no último ano.

MÓDULO 1

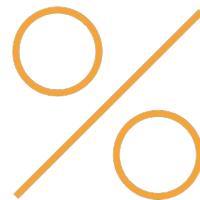
Negociação de Renda Variável

AULA 7

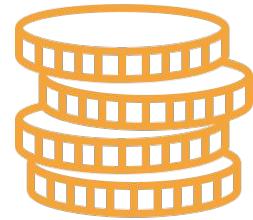
Índices

Índices

Critérios para participação de empresas no **IBOVESPA**:



Volume financeiro maior ou igual a 0,1%
no mercado à vista nos **últimos 12 meses**.



NÃO ser classificado
Penny Stock
(são ações que custam centavos).

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7

Índices

Carteira Teórica

Exemplo

Código	Ação	Tipo	Qtde. Teórica	Part. (%) ^
VALE3	VALE	ON NM	3.158.277,584	9,813
ITUB4	ITAUUNIBANCO	PN N1	4.738.562,684	8,434
BBDC4	BRADESCO	PN N1	3.873.597,664	6,261
B3SA3	B3	ON EDJ NM	2.047.569,597	5,856
PETR4	PETROBRAS	PN N2	4.520.185,835	4,658
ABEV3	AMBEV S/A	ON	4.348.260,598	4,208
BBAS3	BRASIL	ON NM	1.418.466,803	3,104

• • •

HCTX3	CIA HERING	ON NM	126.302,831	0,153
CVCB3	CVC BRASIL	ON NM	145.151,224	0,145
ECOR3	ECORODOVIAS	ON NM	171.079,276	0,140
COLL4	GOL	PN N2	134.613,917	0,132
SMLS3	SMILES	ON NM	58.842,428	0,066
Quantidade Teórica Total			65.693.725,044	100,000

Fonte: B3.com.br

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7

Índices

8

Prof. Eduardo Mira

Carteira Teórica

ÍNDICE AMPLO

ÍNDICE de
GOVERNANÇA

ÍNDICE de SEGMENTOS
e SETORIAIS

ÍNDICE de
SUSTENTABILIDADE

ÍNDICES em parcerias
S&P DOW JONES

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7
Índices

9

Carteira Teórica

ÍNDICE AMPLO

- Ibovespa
- IBRx50
- IBRx100
- IBrA

Amplamente usados pelo mercado e como o nome diz **são amplos** e **NÃO específicos**.

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7

Índices

10

Carteira Teórica

ÍNDICE de GOVERNANÇA

Temos **4 índices** de governança, são eles:

- **IGC (Índice de Ações com Governança Corporativa Diferenciada)**
- **ITAG (Índice de Ações com Tag Along Diferenciado)**
- **IGCT (Índice de Governança Corporativa Trade)**
- **IGC-NM (Índice de Governança Corporativa – Novo Mercado)**

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7

Índices

11

Carteira Teórica

**ÍNDICE de SEGMENTOS
e SETORIAIS**

Temos **16 índices** de segmentos e setoriais, veja alguns deles:

- **IFNC (Índice BM&FBOVESPA Financeiro)**
- **BDRX (Índice de BDRs Não Patrocinados-GLOBAL)**
- **ICB (Índice de Commodities Brasil)**
- **ICON (Índice de Consumo)**
- **IEE (Índice de Energia Elétrica)**
- **IFIX (Índice de Fundos de Investimentos Imobiliários)**
- **IMAT (Índice de Materiais Básicos BM&FBOVESPA)**
- **Índice DI**
- **Etc.**

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7
Índices

12

Carteira Teórica

ÍNDICE de
SUSTENTABILIDADE

- **ICO2 (Índice de Carbono Eficiente)**
- **ISE (Índice de Sustentabilidade Empresarial)**

Temos **2 índices** de sustentabilidade,
são eles:

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7
Índices

13

Carteira Teórica

ÍNDICES em
parcerias
S&P DOW JONES

- **Smart Beta**
- **Índice Brasil ESG**
- **Índice SmallCap Select**
- **Índice de Baixa Volatilidade Altos Dividendos**
- **Índice de Beta Elevado**
- **Índice de Commodities**
- **Índice de Empresas Privadas**
- **Índice de Futuros**
- **Índice de Renda Fixa**

Temos **9 Índices** em
parceria S&P
DowJones, são eles:

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

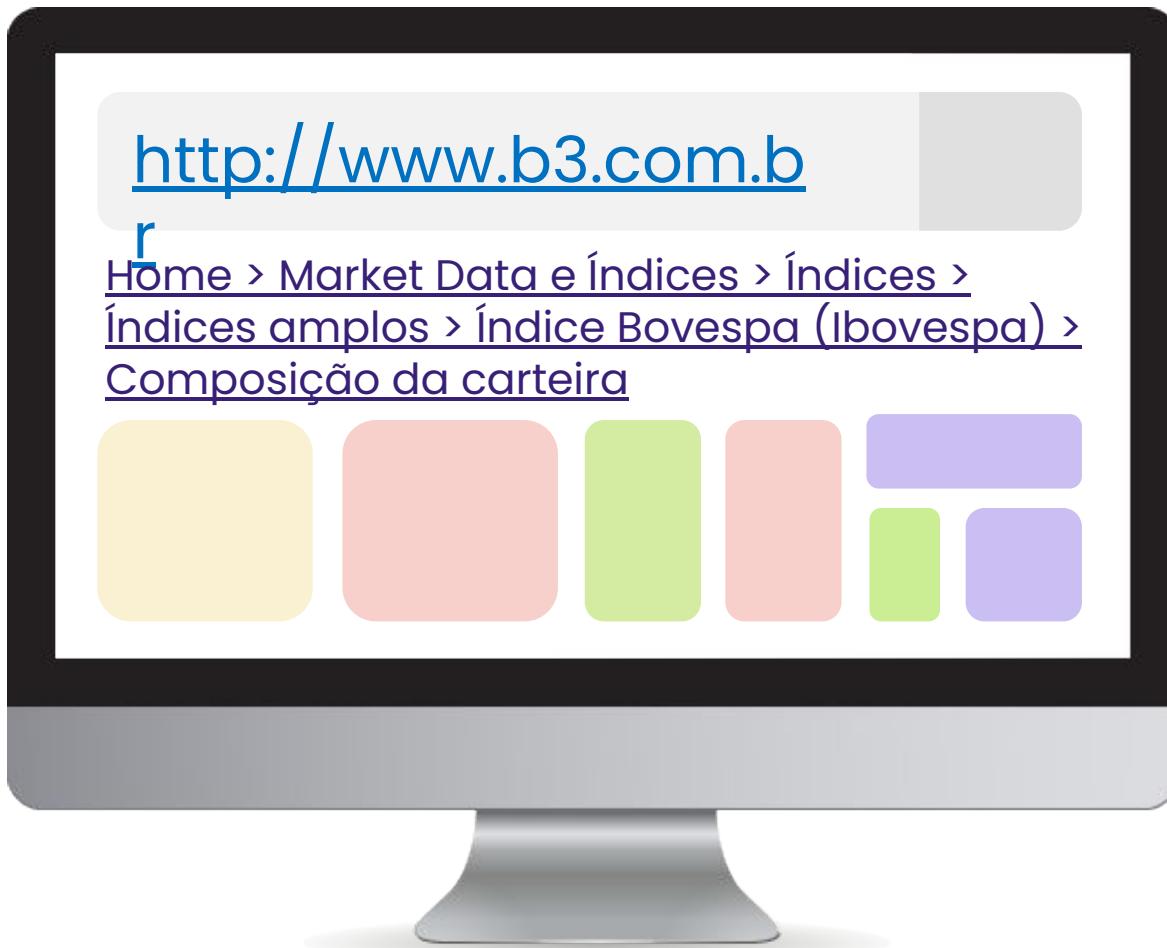
AULA 7

Índices

14

ATIVIDADE

Acessem:



MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7 Índices

15

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7
Índices



RESUMO

16

Nesta aula nós vimos:



Índices

MÓDULO 1

Negociação de Renda Variável

AULA 7
Índices

17

MINHA CARTEIRA
NÚMERO ÚM
Me Poupe !

OBRIGADO!

18