

**ULTRA
TRADER**



MATERIAL DIDÁTICO

CURSO

MERCADO FUTURO

MÓDULO 5

INICIANTES



A técnica antiga de leitura de fita, também conhecida como "Tape Reading", era usada por traders e investidores antes da era das plataformas eletrônicas e da automação no mercado financeiro. Comparando essa técnica com a leitura de fluxo de ordens atual na bolsa usando plataformas eletrônicas, podemos observar várias diferenças significativas:

1. Meio de Execução:

- Tape Reading: A leitura de fita envolvia a observação das cotações e negociações impressas em uma fita de papel em tempo real. Os traders precisavam monitorar fisicamente a fita e interpretar as informações.
- Leitura de Fluxo de Ordens Atual: Nas plataformas eletrônicas, os traders recebem informações em tempo real por meio de telas de computador. As ordens são transmitidas eletronicamente e executadas automaticamente pelo sistema.

2. Velocidade e Eficiência:

- Tape Reading: Era uma técnica mais lenta e suscetível a atrasos na transmissão da informação. Os traders dependiam da velocidade de impressão da fita e da interpretação manual das informações.
- Leitura de Fluxo de Ordens Atual: As plataformas eletrônicas proporcionam uma execução muito mais rápida e eficiente das ordens, permitindo que os traders acessem informações em tempo real e enviem ordens instantaneamente.

3. Disponibilidade de Dados:

- Tape Reading: A informação disponível era limitada às cotações de preços e volume de negociação impressas na fita.
- Leitura de Fluxo de Ordens Atual: As plataformas eletrônicas fornecem uma ampla gama de dados, incluindo o livro de ofertas (order book), informações sobre o volume de ordens de compra e venda, dados de análise técnica e muito mais.

4. Análise:

- Tape Reading: A análise baseava-se principalmente na interpretação de padrões e movimentos de preços na fita, bem como na observação de tendências e reversões.
- Leitura de Fluxo de Ordens Atual: Os traders podem usar algoritmos complexos, indicadores técnicos avançados e análise quantitativa para tomar decisões informadas. A leitura de fluxo de ordens envolve o monitoramento da liquidez e do desequilíbrio entre as ordens de compra e venda.

5. Automatização:

- Tape Reading: Era uma técnica manual que dependia das habilidades individuais do trader.

- Leitura de Fluxo de Ordens Atual: Os traders podem automatizar suas estratégias por meio de algoritmos de negociação de alta frequência (HFT) e sistemas de negociação algorítmica, aproveitando a velocidade das plataformas eletrônicas.

6. Acesso ao Mercado:

- Tape Reading: Era restrito a um grupo seleto de profissionais financeiros que tinham acesso direto ao pregão da bolsa.
- Leitura de Fluxo de Ordens Atual: Está amplamente disponível para traders de varejo por meio de corretoras online, permitindo que um número maior de pessoas participe ativamente do mercado.

Em resumo, a transição da técnica de Tape Reading para a leitura de fluxo de ordens atual nas plataformas eletrônicas trouxe avanços significativos em termos de velocidade, disponibilidade de dados e automação, tornando o mercado mais acessível e eficiente. Os traders modernos podem aproveitar uma gama mais ampla de informações e ferramentas para tomar decisões de negociação informadas.

Conhecer e entender o sistema de Trade Location, observando áreas de aceitação, pontos de controle (P.O.C.), pontos de rejeição (L.V.N. - Low Volume Nodes) e níveis de suporte e resistência (H.V.N. - High Volume Nodes), é fundamental para os traders que desejam tomar decisões informadas e eficazes no mercado financeiro. Esses conceitos são especialmente relevantes na análise de volume e perfil de mercado e podem fornecer valiosas informações para a tomada de decisões de negociação. Aqui está a importância de cada um desses elementos:

1. **Áreas de Aceitação e P.O.C. (Pontos de Controle):**

- As áreas de aceitação representam os níveis de preço em que a maioria das negociações ocorreu durante um determinado período de tempo. O P.O.C. é o preço exato em que ocorreu a maior quantidade de negociações.
- Conhecer as áreas de aceitação e o P.O.C. ajuda os traders a identificar os preços que são considerados justos pelo mercado durante um período específico.
- Essas áreas podem atuar como níveis de suporte ou resistência, e a mudança na posição do P.O.C. pode indicar uma mudança na dinâmica do mercado.

2. **L.V.N. (Low Volume Nodes) - Pontos de Rejeição:**

- Os L.V.Ns representam os níveis de preço em que houve pouco volume de negociação. São áreas onde o mercado rapidamente rejeitou o preço.
- Os L.V.Ns podem atuar como áreas de interesse para os traders, pois indicam que o mercado pode não ter aceitado aqueles preços anteriormente, o que pode levar a reações significativas quando o preço retorna a essas áreas.

3. **H.V.N. (High Volume Nodes) - Suportes e Resistências:**

- Os H.V.Ns são os níveis de preço em que ocorreu um alto volume de negociações. São áreas onde o mercado passou mais tempo negociando.
- Essas áreas são frequentemente vistas como níveis de suporte ou resistência, uma vez que indicam que muitos participantes do mercado têm interesse naqueles preços.
- Os H.V.Ns podem ser usados para identificar áreas-chave em que os traders podem esperar que o preço reaja ou se consolide.

Então, por que é importante para os traders conhecer esses conceitos?

- **Tomada de Decisões Informadas:** O conhecimento desses elementos permite aos traders tomar decisões mais informadas sobre onde entrar e sair de posições. Por exemplo, um trader pode escolher entrar em uma posição de compra perto de um H.V.N. esperando suporte ou esperar por uma rejeição perto de um L.V.N. antes de entrar.
- **Gerenciamento de Riscos:** Saber onde estão os níveis de suporte e resistência com base em H.V.Ns pode ajudar os traders a definir seus níveis de stop-loss e ter uma ideia de onde o mercado pode reverter.
- **Identificação de Oportunidades de Negociação:** O reconhecimento de mudanças na posição do P.O.C. ou a formação de novos H.V.Ns e L.V.Ns pode ajudar os traders a identificar tendências emergentes ou reversões de tendências.
- **Redução de Ruído:** Esses conceitos podem ajudar os traders a filtrar o ruído do mercado e se concentrar em áreas de maior relevância.

Em resumo, o sistema de Trade Location, com foco em áreas de aceitação, P.O.C., L.V.Ns e H.V.Ns, fornece aos traders ferramentas valiosas para tomar decisões informadas, gerenciar riscos e identificar oportunidades de negociação no mercado financeiro. É uma parte essencial da análise de perfil de mercado e pode melhorar significativamente a qualidade das decisões de negociação.

O gerenciamento de risco é um aspecto fundamental da negociação,

especialmente para day traders no mercado futuro, onde as flutuações de preço podem ser rápidas e voláteis. Um bom gerenciamento de risco ajuda a proteger o capital do trader e a garantir que ele possa continuar negociando de forma sustentável ao longo do tempo. Aqui estão algumas regras essenciais para um sólido gerenciamento de risco para um day trader de mercado futuro:

1. **Defina um Limite de Perda Diário:** Estabeleça um limite máximo para as perdas diárias que você está disposto a suportar. Se suas perdas alcançarem esse limite, encerre as operações do dia. Isso ajuda a evitar grandes perdas que podem prejudicar seu capital.
2. **Determine um Tamanho de Posição Adequado:** Calcule o tamanho da posição com base no seu capital e no risco que você está disposto a assumir em uma única negociação. Geralmente, não arrisque mais do que 1% a 2% do seu capital em uma única operação.
3. **Estabeleça Stop Loss e Take Profit:** Sempre use ordens de stop loss para limitar suas perdas e ordens de take profit para garantir que você realize lucros quando atingir suas metas. Essas ordens devem ser definidas antes de entrar em uma operação e com base em análise técnica ou estratégias específicas.
4. **Seja Especialista no seu Ativo:** Não coloque todo o seu capital em uma ativo que você ainda não estudou profundamente e sabe tudo sobre o que acontece em torno do movimento do preço desse Ativo. No Início você tem de se Especializar em um Ativo para conseguir ser lucrativo.
5. **Tenha uma Estratégia de Saída:** Defina regras claras para quando você vai sair de uma posição, independentemente de estar com lucro ou prejuízo. Ter uma estratégia de saída evita decisões impulsivas baseadas em emoções.
6. **Limite a Alavancagem:** Embora a alavancagem possa amplificar ganhos, ela também amplifica perdas. Utilize a alavancagem com cautela e esteja ciente de como ela afeta seu risco total.
7. **Monitore o Mercado Constantemente:** Esteja atento às notícias, eventos econômicos e mudanças nas condições de mercado que possam afetar suas posições. Tenha um plano para lidar com eventos inesperados.
8. **Aprenda com suas Perdas:** Em vez de ver as perdas como fracassos, encare-as como oportunidades de aprendizado. Analise suas operações perdedoras para entender o que deu errado e ajuste sua estratégia conforme necessário.
9. **Mantenha Registros Detalhados:** Mantenha um registro detalhado de todas as suas operações, incluindo datas, horários, preços de entrada e saída, tamanho das posições e resultados. Isso ajuda a avaliar seu desempenho ao longo do tempo.

10. **Esteja Preparado para Parar:** Se você estiver em uma sequência de perdas consecutivas ou estiver emocionalmente abalado, é importante ter a disciplina de encerrar as operações do dia e fazer uma pausa. O mercado estará sempre lá amanhã.

Os Axiomas de gerenciamento de risco são fundamentais para o sucesso de day traders no mercado futuro. Eles ajudam a proteger o capital, controlar as emoções e manter a disciplina durante as operações. Vamos analisar cada um desses Axiomas:

1. **Pratique 1000 horas no simulador ou Replay:** Antes de entrar no mercado real, é essencial que os day traders acumulem experiência em um ambiente simulado. Isso ajuda a entender a dinâmica do mercado, desenvolver estratégias e ganhar confiança sem arriscar dinheiro real.
2. **Comece com o dinheiro que você gastaria sem dó:** Ao começar a operar na conta real, use apenas o dinheiro que você pode perder sem afetar negativamente suas finanças pessoais. Nunca utilize dinheiro que é destinado a despesas essenciais.
3. **Na conta real clique pouco:** Evite operar com tamanhos de posição muito grandes no início. Isso ajuda a controlar o risco e minimizar perdas caso as operações não saiam como planejado.
4. **Vá diminuindo a alavancagem com o tempo e o dinheiro ganho:** À medida que você ganha experiência e acumula lucros consistentes, considere reduzir gradualmente a alavancagem. Isso diminui o risco de grandes perdas.
5. **Não tente ficar rico em um dia:** O day trading não é uma maneira confiável de enriquecer rapidamente. É importante ter expectativas realistas e entender que as vitórias e as perdas fazem parte do jogo.
6. **Opere poucas horas na conta real:** O day trading pode ser mentalmente exaustivo. Evite operar por longas jornadas, pois a qualidade das decisões pode diminuir à medida que o dia avança.
7. **Defina suas metas de ganhar e perder no dia e na semana:** Estabeleça limites claros para seus ganhos e perdas diárias e semanais. Quando esses limites são atingidos, pare de operar. Isso evita que você continue operando emocionalmente após perdas significativas.
8. **Metas Diárias de acordo com a amplitude e frequência:** Adapte suas metas diárias com base na volatilidade do mercado e na frequência das oportunidades. Em dias de alta volatilidade, você pode definir metas mais flexíveis.
9. **Meta Financeira de Acordo com seu Capital e experiência:** Sua meta financeira deve ser proporcional ao seu capital disponível e nível de

experiência. Não se exponha a riscos excessivos apenas para atingir uma meta irrealista.

10. **Só aumente sua mão após pagar uma DARF:** Certifique-se de estar em conformidade com as obrigações fiscais. Pague seus impostos regularmente, e só aumente seu tamanho de posição após considerar os impactos fiscais.
11. **Planeje seus Trades antes de executar:** Ter um plano de negociação é crucial. Antes de cada operação, defina seus pontos de entrada, saída e stop-loss. Seguir um plano ajuda a evitar decisões impulsivas.

Em resumo, o gerenciamento de risco é uma parte essencial do day trading. Seguir essas regras pode ajudar os day traders a manter o controle sobre seu capital, evitar perdas significativas e trabalhar em direção a um sucesso consistente no mercado futuro. Lembre-se de que o day trading envolve riscos substanciais, e é importante estar preparado emocional e financeiramente para enfrentá-los.

CONSIDERAÇÕES FINAIS:

É crucial que um trader siga um processo estruturado para se profissionalizar e progredir em sua carreira de trading de forma sustentável. A transição do curso "Beginner" para o nível "Expert" é uma etapa significativa no desenvolvimento de suas habilidades e conhecimentos. Aqui estão algumas orientações para o trader:

1. **Consistência no Simulador:** Antes de dar o próximo passo, é importante garantir que você tenha sido consistentemente lucrativo e tenha acumulado uma quantidade substancial de horas de prática no simulador. Isso lhe dará confiança e ajudará a desenvolver suas estratégias.
2. **Curso "Expert":** Ao ingressar no curso "Expert", você se aprofundará em conceitos mais avançados, como a leitura do fluxo de ordens e a identificação de regiões críticas no trade location. Certifique-se de prestar muita atenção a essas áreas, pois elas são fundamentais para tomar decisões informadas durante as operações.
3. **Prática Intensa:** Assim como no curso "Beginner", dedique uma quantidade significativa de tempo para praticar as novas habilidades adquiridas no curso "Expert" no simulador. A leitura do fluxo de ordens e

a identificação de regiões importantes exigem prática constante para serem dominadas.

4. **Transição para a Conta Real com Cautela:** Quando você se sentir confiante o suficiente após a conclusão do curso "Expert", considere a transição para a conta real. No entanto, comece com um tamanho de posição muito pequeno, mesmo que você tenha capital disponível. Esta etapa é crucial para preservar seu capital e evitar grandes perdas iniciais.
5. **Gerenciamento de Risco Adequado:** Mantenha um rigoroso gerenciamento de risco, estabelecendo limites para perdas diárias e semanais. Certifique-se de que suas posições sejam dimensionadas de acordo com seu capital e nível de experiência, e use ordens stop-loss para proteger seus investimentos.
6. **Mantenha um Diário de Trading:** Registre todas as suas operações, incluindo as razões para entrar e sair de uma posição, seus sentimentos e observações sobre o mercado. Isso ajudará a avaliar seu desempenho ao longo do tempo e a identificar áreas que precisam de melhoria.
7. **Aprendizado Contínuo:** O mercado financeiro está em constante evolução. Continue a se educar e aprimorar suas habilidades. Esteja aberto a aprender com suas vitórias e derrotas, bem como a buscar orientação de traders mais experientes quando necessário.
8. **Controle Emocional:** Mantenha o controle emocional durante as operações. O medo e a ganância podem ser seus maiores inimigos. Siga seu plano de trading rigorosamente, independentemente de emoções momentâneas.
9. **Avaliação Regular:** Faça avaliações regulares de seu desempenho e faça ajustes em sua estratégia, se necessário. Isso permitirá que você se adapte às mudanças nas condições do mercado.

Lembre-se de que a jornada para se tornar um trader profissional é desafiadora e requer tempo, dedicação e disciplina. A transição do simulador para a conta real é um momento crítico, e é vital preservar seu capital enquanto você ganha experiência e confiança. Com perseverança e um compromisso contínuo com a aprendizagem, você estará no caminho certo para se tornar um trader bem-sucedido no mercado futuro.