



## CURSO IN COMPANY

### MÓDULO PLENO

Destinado aos executivos com responsabilidades nas áreas comerciais, financeira, tesouraria, controladoria, logística, produção e jurídica, *traders* que operam os mercados derivativos, *controllers* e auditores que precisam conhecer com profundidade os mecanismos de proteção existentes no mercado, gestores de risco, profissionais na área de crédito, investidores, conselheiros de empresas, jornalistas que cobrem os mercados de commodities, estudantes dos cursos de graduação, pós-graduação, MBA e demais pessoas interessadas.

Conteúdo programático:

#### 1. Gestão de Risco

- Definição
- Objetivo
- Atividade
- Tipos de risco
- *Value at risk*

#### 2. Os Mercados

- Mercado a termo
- Mercado futuro
- Função da bolsa
- Participantes do mercado
- Mecanismos de integridade financeira (margem de garantia / ajuste diário)

#### 3. Derivativos

- Histórico
- Definição
- Por que derivativos
- Futuros, opções e balcão

#### 4. *Hedge*

- Definição
- Objetivo
- Tipos de *hedge*
- Mercados físico e futuro

#### 5. *Basis*

- Definição
- O *basis* e o *hedge* na compra
- O *basis* e o *hedge* na venda

#### 6. *Spreads*

- Mercado no custo e carregado
- Mercado invertido
- Posicionamento dos fundos

#### 7. O foco das *tradings*

- Fundamentos
- Tomada de posição

#### 8. Opções sobre futuros

- Conceito
- Terminologia
- Estilos: americana e europeia
- Dentro, fora e no dinheiro

Tempo de duração: De 10 a 12 horas

Instrutor: Arnaldo Luiz Corrêa