

Derivativos e Risco

Glauber Matheus Rafael

28-04-2018

Agenda

- 1 Derivativos
- 2 Opções, Futuros e Swaps
- 3 Risco

1 Derivativos

2 Opções, Futuros e Swaps

3 Risco

Contratos que derivam seu valor de outro ativo

Os derivativos são:

- Instrumentos financeiros que derivam seu valor de um ativo subjacente.
- Contrato pré-acordado entre as contrapartes.
- Negociados em bolsa ou mercado de balcão (OTC).

Comprar ou vender um ativo no futuro

- Contrato Futuro ou Termo - comprar ou vender um ativo em uma data futura por um preço determinado.
- Futuro - ajustes diários e variados ativos subjacentes.
- Termo - margem de garantia, incidência de juros e ações como ativo subjacente.
- Ambos contratos são negociados em bolsa.

Agenda

1 Derivativos

2 Opções, Futuros e Swaps

3 Risco

Swaps

Agenda

1 Derivativos

2 Opções, Futuros e Swaps

3 Risco

Probabilidade de eventos adversos

VaR - Valor em Risco

ES - *Expected Shortfall*



Farnam Street Boys

Glauber, Matheus, Rafael



Derivativos e Risco

28-04-2018

13 / 14

