



MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO
UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ
SETOR DE PALOTINA

Departamento de Sociais e Humanas

Ficha 2 (variável)

Disciplina: **Mercados Futuros Agropecuários** Código: DSH067

Natureza:

() Obrigatória

(x) Optativa

(x) Semestral

() Anual

() Modular

Pré-requisito:

Co-requisito:

Modalidade: () Presencial () Totalmente EAD () CH em EAD:

CH Total:

30

Padrão
(PD): 30

Laboratório
(LB):

Campo
(CP):

Estágio
(ES):

Orientada
(OR):

Prática
Específica
(PE):

Estágio de
Formação
Pedagógica
(EFP):

Extensão
(EXT):

Prática Como
Componente
Curricular
(PCC):

EMENTA

Funcionamento e princípios da BMFBovespa. Fundamentos dos Mercados Futuros. Contratos no Setor Agropecuário. O *Hedge* como mecanismo de seguro de preços. O mercado de Opções de Compra e Venda. Estratégias em mercados futuros.

PROGRAMA

1) Contratos e preços futuros. 2) Padronização dos produtos. 3) Pontos de entrega. 4) Padronização dos contratos. 5) Negócios em pregão. 6) Margem de Garantia. 7) Contratos negociados. 8) Custos operacionais. 9) Liquidação dos contratos. 10) Prática de Mercados Futuros. 11) O conceito de Base. 12) Opções em Mercados Futuros. 13) Liquidação da posição. 14) Negociação das Opções. 15) Margem em Opções. 16) Prêmio das Opções. 17) Prática com Opções.

OBJETIVO GERAL

A disciplina pretende fornecer aos alunos uma formação conceitual básica que lhes possibilite a compreensão dos processos de negociação e seguro de preços de compra e venda de produtos agropecuários.

OBJETIVO ESPECÍFICO

Objetiva-se, também, que os alunos sejam capazes de:

-entender os processos de tomada e formação de preços futuros;

-atuar, de forma direta, na elaboração de estratégias de seguro de preços futuros.

PROCEDIMENTOS DIDÁTICOS

Aulas expositivas no sistema online (**todas síncronas**) utilizando a plataforma TEAMS.

Envio de material por via digital (apostila, capítulos de livros e cópia de trechos de aulas presenciais), contato com alunos (pessoal e em grupos nos meios digitais) e cobrança de tarefas de cada aula, feita via email, facebook e whatsapp.

FORMAS DE AVALIAÇÃO

Duas provas bimestrais e um trabalho. A primeira prova forma a primeira nota e a segunda nota é composta pela prova e pelo trabalho com pesos 80 e 20, respectivamente.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

1 Options, Futures e other Derivatives: Englewood Cliffs: Prentice Hall, third edition, 1997.

2 Chance, D.: An introduction to Options and Futures. Orlando: Dryden Press, 1989.

3 Kolb, R.: Understanding Future Markets. Glenview: Scott, Foresman, 1985.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

1 Chicago Board of Trade: Introduction to Hedging. Chicago, 1984.

2 Duffie, D.: Future markets. Englewood Cliffs: Prentice Hall, 1989.

3. Mendes, J.T.G. Economia Agrícola - Princípios Básicos e Aplicações. Curitiba: Editora ZNT Ltda., 1998.

4. Pinho, D.B. E outros. Manual de Economia. São Paulo: Editora Saraiva. Equipe de professores da USP, 1998.

5. Rossetti, J.P. Introdução à economia. São Paulo: Atlas, 1997.

CRONOGRAMA DE ATIVIDADES

- 11/05/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Apresentação do conteúdo;
18/05/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Contratos e preços futuros;
25/05/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Padronização dos produtos;
01/06/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Pontos de entrega;
08/06/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Padronização dos contratos;
15/06/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Negócios em pregão;
22/06/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Margem de Garantia;
29/06/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Contratos negociados e custos operacionais;
06/07/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Liquidação dos contratos;
13/07/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Prática de Mercados Futuros;
20/07/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – O conceito de Base;
27/07/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Opções em Mercados Futuros;
03/08/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Liquidação da posição;
10/08/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Margem em Opções e Prêmio das Opções;
17/08/2021 – Aula síncrona 17:30/19:30 – Prática com Opções.

Validade: 2º semestre de 2020

Professor da Disciplina: Roberto Rochadelli

Assinatura: _____

Chefe de Departamento: Tiago Venturi

Assinatura: _____



Documento assinado eletronicamente por **ROBERTO ROCHADELLI, PROFESSOR DO MAGISTERIO SUPERIOR**, em 26/04/2021, às 11:36, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



A autenticidade do documento pode ser conferida [aqui](#) informando o código verificador **3469653** e o código CRC **6444D88D**.