



Gradiente Linear

Sumário

-  Professor Su Choung Wei
-  História
- GL** A estratégia
-  Desempenho
-  Escolhendo o plano
-  Como parametrizar
-  Contato



Professor Su Choung Wei



Com uma capacidade extraordinária para calcular qualquer coisa, **Su Choung Wei** é um dos professores de Finanças mais didáticos do Brasil. Formado em Matemática pelo IME-USP, também iniciou suas graduações em Biologia e Pedagogia. Trabalhou na indústria farmacêutica e deu aula em cursinhos pré-vestibular até se apaixonar pelo mercado financeiro. Atuou em corretoras como Souza Barros, Banif e Win como estrategista de opções, desenvolvendo modelos matemáticos para as operações.

Hoje trabalha com fórmulas estatísticas e desenvolvimento de estratégias quânticas.



História

Em 1999, iniciei minha trajetória no mercado fazendo um modelo matemático para operar as oscilações do petróleo no médio prazo. O modelo previa uma eficiência operacional a partir dos U\$40 o barril, que na ocasião beirava os U\$10. Posteriormente, o modelo foi testado nas opções da Telemar, se tornando vencedor para ciclos de 6/8 meses. Foi utilizado até 2004, pois embora vencedor, exigia muito monitoramento.

Após mais de 10 anos continuando os estudos de modelos matemáticos voltados para o mercado, cheguei à versão final da Gradiente Linear. Na primeira versão as estratégias operam Mini Dólar e Mini Índice buscando ganhar sobre as pequenas oscilações.

Su Choung Wei



GL *A Estratégia*

Conheça as
estratégias

CLIQUE AQUI

As estratégias desenvolvidas pelo professor Su Choung Wei buscam operar em momentos de pouca volatilidade do mercado, lucrando sobre as pequenas oscilações. Após identificar o cenário ideal para as operações, o robô envia 4 ordens de entrada a limite. Quando uma ordem de entrada é executada, imediatamente o robô envia uma ordem de saída. O robô trabalha com retroalimentação durante o ciclo. Assim, quando a saída é executada, o robô envia uma nova ordem de entrada, seguindo no ciclo até atingir algum critério de parada.

GL *A Estratégia*

Vantagens

- Leitura da volatilidade do mercado
- Fácil parametrização
- Ordens de entrada e saída a limite (exceto as ordens de stop, enviadas a mercado)
- Robô totalmente hospedado na nuvem (não é preciso manter o seu computador ligado)
- Acompanhamento das ordens em tempo real
- Ferramentas para gestão de risco

Gradiente WDO
**ESTRATÉGIA
ESGOTADA**

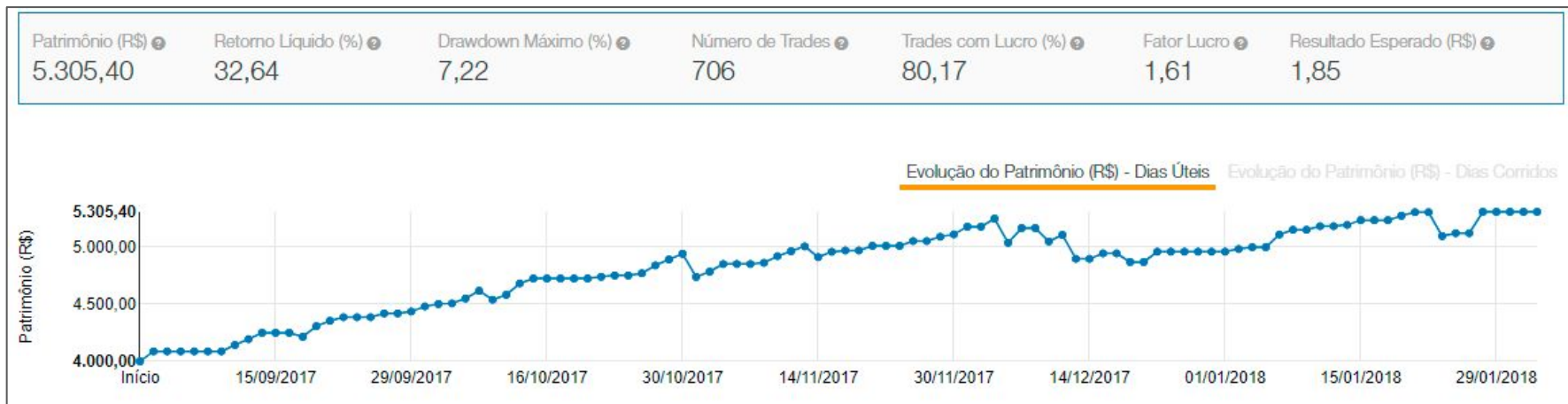
Assine a estratégia
para WIN
[CLIQUE AQUI](#)

Desempenho - WDO



Veja o gráfico interativo clicando aqui!

Desempenho - WIN



Veja o gráfico interativo clicando aqui!



Escolhendo seu plano SmarttBot



Lite

Limites do plano

2 Robôs executando
1 Mini Contrato por ordem

Plano ideal para

quem está começando a operar no mercado futuro e quer conhecer a plataforma. Permite utilizar apenas a configuração mínima da estratégia.



Pro

Limites do plano

5 Robôs executando
6 Mini Contratos por ordem

Plano ideal para

quem já opera no mercado futuro e quer operar com mais contratos e robôs na estratégia Gradiente Linear. É o plano mais escolhido da SmarttBot.



Expert

Limites do plano

15 Robôs executando
25 Mini Contratos por ordem

Plano ideal para

quem já possui uma boa experiência no mercado futuro e quer montar um portfólio de robôs.



**Conheça
nossos
outros
planos e
preços**

MAIS INFORMAÇÕES



Como parametrizar

Os próximos slides mostram detalhadamente como realizar a parametrização de seu robô. Apresentaremos os campos que deverão ser preenchidos e o significado de cada um deles.

Serão detalhados:

1. Papel negociado
2. Gerenciamento de entrada
3. Gerenciamento do ciclo ativo e de saídas
4. Critérios de entrada por horário
5. Critérios de saída diários

1- Papel Negociado | Mercado e Papel que o robô irá operar

▼ Papel Negociado

Mercado ? Código ? *

- **Mercado:** A estratégia Gradiente Linear, na primeira versão, pode operar somente na BM&F. Não é necessário preencher nada neste campo, pois ele apenas indica em qual mercado o robô vai operar.
- **Código:** A estratégia poderá operar apenas 1 código. Serão ofertados dois robôs, um para o contrato futuro do Mini-Índice (WIN) e um para o contrato futuro do Mini-Dólar (WDO). O exemplo da imagem é o de WDO. Não é necessário preencher este campo, pois ele apenas indica em qual código o robô irá operar.

2- Gerenciamento de Entrada | Configurações dos critérios de entrada

▼ Gerenciamento da Entrada

Quantidade de contratos por ordem ? *	Exposição Máxima ?	Frequência de Operação	Variação máxima diária ? *
<input type="text" value="1"/>	<input type="text" value="4"/>	<input type="radio" value="Baixa"/> <input checked="" type="radio" value="Média"/> <input type="radio" value="Alta"/>	<input type="text" value="0.60%"/> <input checked="" type="text" value="0.70%"/> <input type="text" value="0.80%"/>

- **Quantidade de contratos por ordem:** Número de contratos que o robô irá operar em cada ordem. Esse número deve respeitar os limites do seu plano e os limites da estratégia.
- **Exposição Máxima:** A estratégia envia 4 ordens em preços diferentes, por isso a exposição máxima sempre será 4 vezes a quantidade de contratos por ordem. Esse campo não é editável, apenas informa com quantos contratos no máximo o robô pode ficar posicionado.
- **Frequência da Operação:** É possível determinar a frequência de operação do robô. A frequência baixa irá gerar menos entradas e a alta irá gerar mais entradas.
- **Variação máxima diária:** Para evitar dias não propícios à operação do robô, é possível determinar o tamanho do gap máximo de abertura para permitir entradas. No exemplo, o robô não irá operar no dia que a diferença entre o fechamento do dia anterior e a abertura do dia atual for maior que 0,70%.

3- Gerenciamento do Ciclo Ativo | Critérios de saída do ciclo

▼ Gerenciamento do Ciclo Ativo



Stop Gain por ordem ? * 1.00


Stop Loss por ciclo ? * 1.00



- **Stop Gain por ordem:** Cada ordem de entrada executada gera uma ordem de saída de ganho, enviada logo após a execução da ordem de entrada. Esse campo deve ser preenchido em pontos e representa a diferença da ordem de entrada e a ordem de saída correspondente.
- **Stop Loss por ciclo:** Todo ciclo deve possuir um valor de Stop Loss. Esse campo deve ser preenchido e representa em pontos a distância do Stop Loss em relação à **última ordem** de entrada. Por exemplo, com um Stop Loss por ciclo de 1 ponto, como na imagem, se o robô enviar 4 ordens de compra nos preços 3172, 3171, 3170 e 3169, executar essas 4 entradas e o preço atingir o valor 1 ponto abaixo da última entrada, ou seja, 3068, o robô envia uma ordem de venda a mercado para zerar a posição e encerrar o ciclo.

4 - Módulo Day Trade | Critérios de entrada por horário



▼ Módulo Day Trade

Apenas Day Trade  

Horário inicial para abrir posições 

Horário final para zerar carteira  

17:30

Horário inicial  

09:00

- **Horário final para zerar carteira:** Horário final em que a carteira é forçadamente zerada. Neste horário, qualquer posição aberta é encerrada com uma ordem a mercado, e todas as ordens são canceladas. O robô **não** opera **após** esse horário.
- **Horário inicial para abrir posições:** Se ativado, define o horário inicial a partir do qual posições podem ser abertas. O robô **não** opera **antes** desse horário.

5 - Módulo Day Trade | Critérios de saída por ganho/perda diário

Stop diário de ganho ?	Valor absoluto financeiro (R\$) ? *
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="text" value="200,00"/>
Stop diário de perda ?	Valor absoluto financeiro (R\$) ? *
<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="text" value="200,00"/>

- **Stop diário de ganho:** Se ativado, define saída por stop de ganho diário. Após atingir esse valor qualquer posição que estiver aberta é encerrada com uma ordem a mercado, e todas as ordens são canceladas. O robô **não** opera mais no dia após atingir esse valor de ganho. Esse campo é preenchido em valor absoluto financeiro (Reais - R\$).
- **Stop diário de perda:** Se ativado, define saída por stop de perda diário. Após atingir esse valor, qualquer posição que estiver aberta é encerrada com uma ordem a mercado, e todas as ordens são canceladas. O robô **não** opera mais no dia após atingir esse valor de ganho. Esse campo é preenchido em valor absoluto financeiro (Reais - R\$).

Contato



São Paulo: +55 11 4118-0492
Belo Horizonte: +55 31 2573-0048
contato@smarttbot.com

Gradiente Linear

Su Choung Wei
duvidas.estruturadas@gmail.com

*Enviar o e-mail com assunto "SmarttBot".