



**E-book
Estratégia**

Toque
na Mídia



DISCLAIMER

O conteúdo desse ebook é puramente educacional, e em nenhum momento indica parâmetros que devem ser usados nos robôs ou em qualquer tipo de investimento.

A parametrização e ativação do robô é de total responsabilidade do cliente. O SmarttBot é uma ferramenta para investidores e traders com perfil de risco agressivo. Antes da utilização esteja ciente de todos os riscos.

SUMÁRIO

- Resumo;
- Papel Negociado;
- Gráfico;
- Gerenciamento de Ordens;
- Critério de entrada;
- Aumento de posição;
- Filtros;
- Critérios de Saída ;
- Critérios de Saída Diários ;
- Restrições de horários;
- Módulo Day Trade;
- Contato;

RESUMO

Toque na Média é uma estratégia aberta, na qual o usuário tem a liberdade de parametrizar do seu jeito. Possuindo diversos novos recursos, a possibilidade de diversificação da sua carteira de robôs aumentou de forma significativa. Alguns dos recursos:

- **Aumento de posição;**
- **Regra toque na média;**
- **Aumento de posição no toque na média;**
- **Diversos filtros;**

Todos os recursos serão explicados posteriormente neste ebook.



Toque
na Média

PAPEL NEGOCIADO

Para essa estratégia **escolhe-se apenas 1 ativo (código)** que será monitorado e negociado pelo robô.

Pode ser qualquer instrumento financeiro listado no segmento Bovespa que esteja disponível para negociação em pregão eletrônico, e índice futuro ou dólar futuro na BM&F.

Papel Negociado

Mercado ⓘ

BM&F

BOVESPA

Código ⓘ*

WIN%

GRÁFICO

Tipo do gráfico: A estratégia utiliza somente o gráfico de **candlestick** para a definição de entradas. Pode-se escolher o tempo gráfico dentre as seguintes opções: 1, 5, 10, 15, 30, e 60 minutos.

Gráfico



Tempo gráfico (minutos) ⓘ

1 MIN	5 MIN	10 MIN	15 MIN	30 MIN	60 MIN
-------	-------	--------	--------	--------	--------

GERENCIAMENTO DE ORDENS

Quantidade de contratos: Número de contratos/ações negociados por trade (operação).

Pode-se escolher o **sentido de operação** da estratégia. O sentido determina quais tipos de entradas a estratégia fará. Uma entrada é a abertura de uma nova posição através de uma ordem de compra ou venda. As opções disponíveis são:

- **Apenas comprado:** a estratégia só fará entradas se uma compra for indicada pelos critérios de entrada;
- **Apenas vendido:** a estratégia só fará entradas se uma venda for indicada pelos critérios de entrada;
- **Comprado e vendido:** a estratégia fará entradas quando indicadas compras ou vendas.

Gerenciamento de Ordens

Quantidade por ordem (Tamanho da posição) ⓘ *

2

Sentido das ordens ⓘ

Comprado e vendido

Critério de entrada

É possível escolher se o robô irá entrar em uma operação enviando uma ordem à **mercado** ou **limite**.

Ordem à Mercado: é executada ao preço ofertado pela contraparte da operação e o investidor não determina preço limite para sua execução.

Ordem Limite: o investidor delimita o limite de preço para que a ordem seja executada.

Spread para executar a ordem limite: é possível determinar o intervalo de pontos aceitável no qual a ordem pode ser executada.

Tempo para execução limite: tempo em segundos que a ordem à limite tem para ser executada, caso o tempo inspire, ela poderá ser **cancelada** ou **executada à mercado**.

Tipo do envio de ordem de entrada ⓘ

A MERCADO

LIMITE

Sentido do Spread ⓘ

A FAVOR

CONTRA

Spread para executar a ordem limite ⓘ*

0,15

Tempo para execução limite ⓘ*

60

Operação executada na expiração da ordem limite ⓘ

EXECUTAR À MERCADO

CANCELAR

Critério de entrada

O critério de entrada que irá caracterizar a principal regra da estratégia é a configuração da média móvel. É baseado nela que o robô irá realizar entradas quando o preço tocar este indicador.

Quando o preço tocar de cima para baixo o robô irá efetuar uma compra; quando o preço tocar de baixo para cima o robô irá efetuar uma venda.

Número de períodos: número de períodos a ser usado para o cálculo da média móvel;

Valor usado: determina se o valor utilizado para o cálculo da média móvel curta é o de abertura, fechamento, máxima ou mínima dos candles;

Tipo: se a média curta a ser usada é Simples (aritmética) ou Exponencial (mais peso para os valores mais recentes);

Deslocamento: número de períodos deslocados para o cálculo da média;

Média móvel: Número de períod...

20

Média móvel: Valor usado ?

Fechamento

Média móvel: Tipo ?

Exponencial

Média móvel: Deslocamento ? *

0

AUMENTO DE POSIÇÃO POR TOQUE NA MÉDIA

Nesta estratégia, temos a possibilidade de configurar o robô para realizar um aumento de posição por toque na média. O ideal é que você utilize uma média móvel mais curta para a realização de entradas (exemplo: 6 períodos) e uma mais longa para o aumento (exemplo: 14 períodos).

Pode-se também utilizar a mesma média móvel de entrada para realizar o aumento.

É importante ressaltar que **não é possível utilizar o aumento por toque na média junto com os aumentos de posição contra e/ou a favor.**

Os parâmetros vistos nessa feature são iguais a do critério de entrada, com exceção do **Volume**, neste parâmetro, você irá passar uma lista contendo o número de contratos em que o robô irá aumentar posição a cada toque na média.

No exemplo a seguir, temos que a lista possui os números **1,2** ou seja, no primeiro toque da média configurada para aumento de posição, o robô irá efetuar um aumento de posição com 1 contrato e no segundo toque com 2 contratos.

AUMENTO DE POSIÇÃO POR TOQUE NA MÉDIA

Aumento de Posição

Ativar aumento de posição utilizando toque do preço na média móvel ?



Volume (Lista separada por vírgulas) ? *

1,2

Média móvel: Número de períod...

20

Média móvel: Valor usado ?

Fechamento

Média móvel: Tipo ?

Exponencial

Média: Deslocamento ? *

0

O robô sempre irá realizar os aumentos de posição após o Horário final de entrada e durante janelas de bloqueio de horário, independentemente do tipo de ordem parametrizada.

AUMENTO DE POSIÇÃO CONTRA

Habilitando o **aumento de posição contra**, o robô irá realizar aumentos de posição quando a operação estiver sendo perdedora. As configurações para essa feature são:

- **Pontos/R\$ para aumento de posição:** neste campo você irá inserir os pontos (WDO e WIN) ou R\$ (Ações) referente ao preço de entrada ou preço médio da posição. As pontuações/R\$ devem ser separados por vírgula, exemplo: se você deseja que o robô aumente posição quando estiver perdendo 100 pontos e depois realize outro aumento quando estiver perdendo 200 pontos, basta inserir: 100,200
- **Contratos para aumento de posição:** neste campo você irá inserir o número de contratos (WDO e WIN) ou papéis (Ações) em que você deseja que seu robô execute quando o parâmetro acima for alcançado, exemplo: se você deseja que seu robô entre com 1 contrato no primeiro aumento e mais 1 contrato no segundo, você deve preencher da seguinte forma: 1,1
- **Aumento de posição em relação:** você irá escolher se o robô deseja realizar o aumento de posição referente ao preço de entrada ou ao preço médio da posição.
- **Tipo:** neste campo você irá selecionar se deseja que as ordens de aumento de posição contra sejam executadas à

AUMENTO DE POSIÇÃO CONTRA

Observações:

- A soma do número de contratos que você irá aumentar posição respeitará o limite máximo de contratos do seu plano atual na SmarttBot.
- Caso você habilite o aumento de posição contra, o aumento de posição a favor não poderá ser habilitado.
- A feature “Dobrar posição na entrada seguinte a uma perda (Martingale)” não poderá ser habilitada caso habilite qualquer aumento de posição.

Aumento de Posição ^

Ativar aumento de posição ⓘ



Pontos para aumento de posiçã...

100,200

Contratos por aumento de posiç...

1,1

Aumento de posição em relação...

À primeira entrada ▾

Direção dos aumentos ⓘ

CONTRA

A FAVOR

Tipo ⓘ

AUMENTO DE POSIÇÃO A FAVOR

Habilitando o **aumento de posição a favor**, o robô irá realizar aumentos de posição quando a posição estiver sendo vencedora. As configurações para essa feature são:

- **Pontos/R\$ para aumento de posição:** neste campo você irá inserir os pontos (no caso de WDO e WIN) ou R\$ (no caso de ações) referente ao preço de entrada ou preço médio da posição. As pontuações/R\$ devem ser separados por vírgula, exemplo: se você deseja que o robô aumente posição quando estiver ganhando 300 pontos e depois outro aumento quando estiver ganhando 600 pontos, basta inserir: 300,600
- **Contratos para aumento de posição:** neste campo você irá inserir o número de contratos (no caso de WDO e WIN) ou papéis (no caso de ações) em que você deseja que seu robô execute quando o parâmetro acima for alcançado, exemplo: se você deseja que seu robô entre com 1 contrato quando estiver ganhando 300 pontos e mais 2 contrato quando estiver ganhando 600 pontos, você deve preencher da seguinte forma: 1,2
- **Aumento de posição em relação:** você irá escolher se o robô deseja realizar o aumento de posição referente ao preço de entrada ou ao preço médio da posição.

AUMENTO DE POSIÇÃO A FAVOR

Observações:

- A soma do número de contratos que você irá aumentar posição respeitará o limite máximo de contratos do seu plano atual na SmarttBot.
- Caso você habilite o aumento de posição a favor, o aumento de posição contra não poderá ser habilitado.
- A feature “Dobrar posição na entrada seguinte a uma perda (Martingale)” não poderá ser habilitada caso habilite qualquer aumento de posição.

Aumento de Posição

Ativar aumento de posição 



Pontos para aumento de posiçã...

300,600

Contratos por aumento de posiç...

1,2

Aumento de posição em relação...

À primeira entrada 

Direção dos aumentos 

CONTRA

A FAVOR

FILTRO DE ENTRADA

Nesta parte da criação de sua estratégia, são disponibilizados dois filtros: **Filtro por média móvel do volume de contratos** e **Filtro dos dias da semana**.

Filtro por média móvel do volume de contratos: Esse recurso possibilita ao trader configurar o robô para realizar entradas somente quando o volume estiver acima de uma **Média de Volume** parametrizada. A **Média de volume** pode ser **Simples** ou **Exponencial** e o **Número de períodos** também pode ser escolhido.

Filtro por média móvel do volume de contratos ?



Média de volume: Número de períodos ? *

20

Média de volume: Tipo ?

SIMPLES

EXPONENCIAL

FILTRO POR VARIAÇÃO DO ATIVO

O **Filtro por Variação do Ativo** faz com que o robô só opere dentro do range parametrizado, ou seja, caso o ativo no qual o robô esteja monitorando estiver acima de +X% ou abaixo de -X% o robô não irá realizar entrada, exemplo:

Supondo que você ligou o **Filtro por Variação do Ativo** com a **Variação Permitida** parametrizada com o valor absoluto de 3, o robô só irá operar caso o ativo esteja entre o range de -3% a +3%. Fora desse range, por mais que os critérios de entrada sejam cumpridos, o robô não irá operar.

É válido ressaltar que esse filtro auxilia muito em mercados muito voláteis, não permitindo o robô operar quando por exemplo o WIN está com uma variação perto de entrar em Limit Move (por volta dos 10%).

Filtro de variação do ativo (%) ?



Variação permitida (%) ?

3,00

FILTRO DE ENTRADA

Filtro dos dias da semana: Com esse filtro você irá poder escolher os dias da semana que deseja que o seu robô opere. Com ele será possível evitar dias em que você acredita que o mercado irá possuir uma grande volatilidade ou até mesmo dias em que o seu robô historicamente não vai bem.

Filtro de dia da semana ?



Segunda



Terça



Quarta



Quinta



Sexta



CRITÉRIOS DE SAÍDA

Essa estratégia pode ser configurada para fazer saídas (ou eliminações) com base nos seguintes parâmetros:

- Saída por toque na média;
- Stop Loss;
- Stop Gain;
- Stop Móvel;
- Realização Parcial;

SAÍDA POR TOQUE NA MÉDIA

Nesta estratégia, temos a possibilidade de configurar o robô para sair por um toque na média. O ideal é que você utilize uma média móvel mais curta para a realização de entradas (exemplo: 9 períodos) e uma mais longa para a saída (exemplo: 21 períodos).

Os parâmetros encontrados nessa feature são os mesmos do Critério de entrada.

Saída por toque na média 



Média móvel: Número de períod...

20

Média móvel: Valor usado 

Fechamento

Média móvel: Tipo 

Exponencial

Média: Deslocamento *

0

STOP LOSS

Este parâmetro define quanto uma posição deve estar perdendo para que seja encerrada.

O valor pode ser inserido em valores absolutos (em reais e centavos para ações ou pontos para contratos) ou em valores percentuais (para ações).

O acionamento do stop se dá quando a diferença entre o preço atual e o preço médio da posição atual atinge ou ultrapassa o valor configurado.

Obs: Ordem Stop Loss sempre é enviada a mercado, no qual pode ocorrer slippage.

Stop fixo de perda (stop loss) ⓘ	Tipo do valor do stop ⓘ	Valor ⓘ*
<input checked="" type="checkbox"/>	Absoluto (Pontos para BM&F e Centavos para Bovespa) ▾	530,00

STOP GAIN

Este parâmetro define quanto uma posição deve estar ganhando para que seja encerrada.

O valor pode ser inserido em valores absolutos (em reais e centavos para ações ou pontos para contratos) ou em valores percentuais (para ações).

O acionamento do stop se dá quando a diferença entre o preço atual e o preço médio da posição atual atinge ou ultrapassa o valor configurado.

Obs: É possível escolher se a ordem será enviada a mercado ou limite.

Stop fixo de ganho (stop gain/take profit) ⓘ

Tipo do valor do stop ⓘ

Valor ⓘ*

Tipo de ordem ⓘ

Absoluto (Pontos para BM&F e R\$ para Bovespa) ▾ 3,00

MERCADO LIMITE

STOP MÓVEL DE GANHO

Para o **stop móvel** devem ser informados dois valores, ambos em valores absolutos (em reais e centavos para ações ou pontos para contratos) ou ambos em valores percentuais (para ações). O primeiro valor é o de Início (Ativação) e indica quanto uma posição deve estar ganhando para que o stop móvel seja acionado.

O segundo valor é o de "Distância" e indica quanto a estratégia deve perder, com relação ao ganho máximo já registrado na posição atual, para que uma eliminação seja feita.

O Stop Móvel acompanha o preço de acordo com a parametrização do critério de "Ativação" e "Distância". Porém, é válido destacar que o critério de "Ativação" toma por base o preço de compra/venda e o critério "Distância" toma por base o preço negociado à mercado.






Quando o stop é acionado pela "Ativação", a base passa a ser o preço naquele exato momento. Após acionado e ocorrer uma variação contra a tendência de valor maior ou igual a "Distância", então o robô irá encerrar a operação.

Stop móvel de ganho (trailing stop) ⓘ	Tipo do valor do stop ⓘ	Início (Ativação) ⓘ*	Distância ⓘ*
<input checked="" type="checkbox"/>	Absoluto (Pontos para BM&F e Centavos para Bovespa) ▾	150,00	50,00

STOP MÓVEL DE GANHO

Exemplo: Se um robô comprou 1 contrato ao preço de 100.000 pontos e a ativação do stop móvel está parametrizada para ativação de 50 pontos e distância 25 pontos, então o stop móvel irá acionar caso ocorra de o preço atingir 100.050 pontos.

A partir desse momento ele passa a acompanhar o preço do mercado como base e, caso o preço recue 25 pontos do maior preço registrado dentro da operação, o robô encerrará a posição. Nesse exemplo, se o preço for em 100.150 e cair para 100.125 pontos, ele irá sair do mercado por que a distância de 25 pontos ocorreu.

Stop móvel de ganho (trailing stop) 	Tipo do valor do stop 	Início (Ativação)  *	Distância  *
<input checked="" type="checkbox"/>	Absoluto (Pontos para BM&F e Centavos para Bovespa) 	150,00	50,00

REALIZAÇÃO PARCIAL

Para a **realização parcial** deve ser informado em valores absolutos (em reais e centavos para ações ou pontos para contratos) ou em valores percentuais (para ações) quanto uma posição deve estar ganhando para que seja feita uma realização parcial, e a quantidade de ações/opções ou contratos, em valores absolutos (quantidade absoluta de ações ou contratos) ou em valores percentuais (percentual de ações ou contratos da quantidade posicionada), que serão eliminados quando o valor de ganho for atingido.

O acionamento da realização parcial se dá quando a diferença entre o preço atual e o preço médio da posição atual atinge ou ultrapassa o valor configurado.

Realização parcial 	Tipo do valor do stop 	Valor do stop  *	Quantidade de ativos: Tipo 	Quantidade de ativos: Valor  *
	Absoluto (Pontos para BM&F e R\$ para Bovespa) 	50,00	Absoluto 	1

BREAK EVEN

Este parâmetro define a alteração do stop fixo de perda para o mesmo preço da ordem de entrada, somente após a ocorrência de uma realização parcial.

Realização parcial 	Tipo do valor do stop 	Valor do stop  *	Quantidade de ativos: Tipo 	Quantidade de ativos: Valor  *
<input checked="" type="checkbox"/>	Absoluto (Pontos para BM&F e R\$ para Bovespa) ▾	50,00	Absoluto ▾	1

Break-even: Posicionar stop fixo de perda no preço de entrada após realização parcial 

CRITÉRIOS DE SAÍDA DIÁRIOS

A estratégia permite a ativação de **critérios de saída diários**, que oferece recursos para limitar uma perda máxima no dia, um ganho máximo no dia e uma quantidade definida de trades, são eles:

- **Stop diário de perda;**
- **Stop diário de ganho;**
- **Parar após X trades no dia;**

STOP DIÁRIO DE PERDA

Valor absoluto financeiro (saldo day trade do robô) que o robô deve estar perdendo, no acumulado de todos os trades do dia, para que elimine qualquer posição em aberto e também não abra mais posições.

Stop diário de perda ⓘ	Valor absoluto financeiro (R\$) ⓘ*
<input checked="" type="checkbox"/>	90,00

STOP DIÁRIO DE GANHO

Valor absoluto financeiro (saldo day trade do robô) que o robô deve estar ganhando, no acumulado de todos os trades do dia, para que elimine qualquer posição em aberto e também não abra mais posições.

Stop diário de ganho ⓘ	Valor absoluto financeiro (R\$) ⓘ *
<input checked="" type="checkbox"/>	110,00

PARAR APÓS X TRADES NO DIA

Permite parar o robô caso o robô tenha feito uma quantidade definida de trades no dia e caso o saldo do dia esteja positivo ou negativo ou ambos. Após os X trades, o robô verifica se a condição de parada está satisfeita (se o seu saldo diário é positivo, negativo ou ambos) para poder parar. Se o robô parar de operar em um dia por esse critério, ele não irá abrir mais nenhuma posição no dia corrente.

Exemplo: Se $X = 1$, se for para parar de operar apenas com saldo positivo e o primeiro trade for de prejuízo, o robô não irá parar. Mas, se o segundo trade for de lucro e ficar com saldo positivo, o robô irá parar. Ou seja, o número de trades X é tratado como a quantidade mínima de trades que devem ocorrer para a avaliação da condição de parada. Ocorrendo esta quantidade, a primeira vez que atender a condição definida, o robô irá parar naquele dia.

Essa condição continuará válida apenas enquanto o robô estiver em execução. Caso o robô seja reiniciado no mesmo dia, a estratégia poderá operar novamente no dia.

Parar após X trades no dia ⓘ	Número de trades (X) ⓘ*	Parar robô se estiver com saldo no dia ⓘ
<input checked="" type="checkbox"/>	3	Apenas positivo

RESTRIÇÕES DE HORÁRIO

A estratégia permite a definição de restrições de horário para que o robô possa começar a abrir posições e parar de abrir posições.

Horário inicial para abrir posições*: hora mínima para novas posições serem abertas. Sinais de entrada que acontecerem antes do horário configurado serão ignorados.


Horário final para abrir posições*: hora máxima para novas posições serem abertas. Sinais de entrada que ocorrerem depois do horário configurado serão ignorados. Posições em aberto não são eliminadas com este parâmetro.


Janelas de bloqueio: durante o intervalo configurado o robô não fará novas entradas. Ele ainda executará saídas e reversões caso o parâmetro **Permitir reversões** estiver ligado, ou seja, se o robô estiver posicionado quando a janela de bloqueio é ativada, ele não irá sair até que os parâmetros de saída sejam cumpridos.


**Todos os horários configurados nos parâmetros da estratégia devem ser informados no formato hh:mm.*

RESTRIÇÕES DE HORÁRIO


Restrições de Horário


Horário inicial para abrir posições 


Horário final para abrir posições 

Horário final *


16:30

Janela de bloqueio 1 


Permitir reversões 

Horário inicial *

11:00

Horário final *


12:00


Janela de bloqueio 2 

MÓDULO DAY TRADE

Apenas Day Trade: se ativado, oferece recursos para garantir que posições abertas sejam encerradas no mesmo dia, basta configurar o Horário final para zerar carteira e o robô. Além de eliminar qualquer posição em aberto neste momento, o robô também não fará novas entradas após ele.

Módulo Day Trade

Apenas Day Trade 

Horário final para zerar carteira *

16:50



CONTATOS

Site: www.smarttbot.com

Telephone: (11) 4118-0492 / (31) 2573-0048

Email: contato@smarttbot.com

