

PORTFÓLIO PARA MESA PROPRIETÁRIA

# COMBO 5PI

## Configuração recomendada para cada plano da 5PI

Cinco robôs rodando juntos em WINFUT e WDOFUT, com a quantidade de contratos calibrada plano a plano. Tudo o que está aqui saiu de **1.226 pregões reais** de histórico, simulando o teste começando em **todas as datas possíveis** da janela.

## Cinco robôs, cinco comportamentos diferentes

O COMBO 5PI não é um robô escalado. São cinco estratégias com lógicas distintas rodando na mesma conta, em **dois ativos diferentes**: quatro no índice e uma no dólar. **É a combinação delas que segura o recuo dentro do limite da mesa**, que é exatamente o ponto onde a maioria dos testes morre.

| ROBÔ   | ATIVO     | TIPO                 | PREGÕES | DIAS POSITIVOS | RESULTADO (1 CONTRATO) |
|--------|-----------|----------------------|---------|----------------|------------------------|
| WIN_10 | WINFUT    | Pullback · 6 min     | 958     | 57,7%          | R\$ 7.687              |
| WIN_16 | WINFUT    | Scalper · 5 min      | 553     | 80,7%          | R\$ 5.917              |
| WIN_22 | WINFUT    | Tendência · 31 renko | 402     | 40,0%          | R\$ 8.875              |
| WIN_25 | WINFUT    | Scalper · 6 min      | 581     | 79,5%          | R\$ 6.163              |
| WDO_08 | WDOFUT    | Scalper · 5 min      | 951     | 67,2%          | R\$ 14.635             |
| COMBO  | WIN + WDO | Os cinco juntos      | 1.226   | 68,4%          | R\$ 43.277             |

Janela com um dos cinco robôs: **25/08/2021 a 26/08/2026**, 1.226 pregões. Valores por contrato, já com emolumentos e deságio de execução. Não inclui corretagem.



Curva de cada robô isolado, **1 contrato**. Repare que as curvas não sobem ao mesmo tempo: quando o WIN\_22 fica parado, o WDO\_08 e os scalpers continuam entregando. É esse desencontro que reduz o recuo do conjunto.

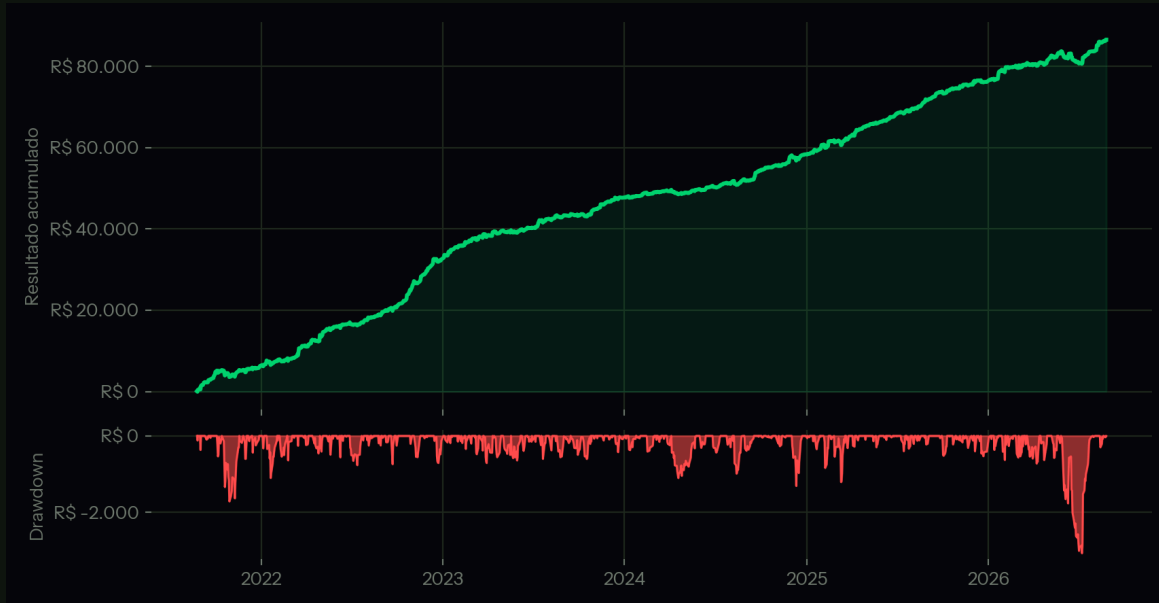
### POR QUE ISSO IMPORTA NO TESTE

#### Na mesa, o que reprova é o recuo, não a falta de lucro

Em todo plano da 5PI a **meta é igual ao limite de perda**. Então não adianta ter um robô que ganha muito e sofre muito: ele bate no limite antes de bater na meta. **O COMBO existe para achatar a oscilação**, e é isso que faz a diferença nos números das próximas páginas.

## O que o COMBO fez em 5 anos

Curva do portfólio completo com **2 contratos por robô**, que é a configuração recomendada para o Book 2k. Embaixo, o drawdown da curva.



Acumulado e drawdown do COMBO 5PI com **2 contratos por robô**, de 25/08/2021 a 26/08/2026.

### RESULTADO NO PERÍODO

**R\$ 86.554**

1.226 pregões · ~R\$ 17.300  
por ano

### MÉDIA POR PREGÃO

**R\$ 71**

68,4% dos dias no positivo

### RECUBO TÍPICO NO TESTE

**R\$ 970**

p95 · limite do Book 2k: R\$  
2.000

### MESES POSITIVOS

**56 de 61**

91,8% dos meses

### MELHOR MÊS

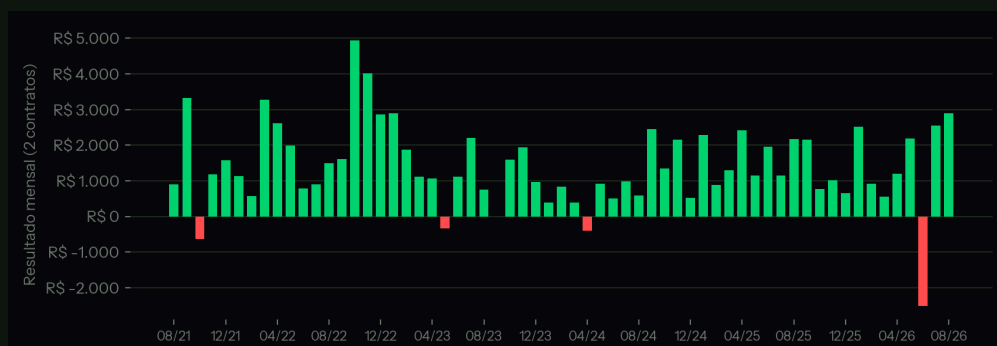
**R\$ 4.938**

média de R\$ 1.419 por mês

### PIOR MÊS

**R\$ -2.522**

máx. 6 pregões negativos  
seguidos



Resultado mês a mês com **2 contratos por robô**. O drawdown de R\$ 3.070 do gráfico acima é da curva inteira de 5 anos: **não é o que você sofre dentro de um teste**, que dura semanas. O número que importa para a mesa é o recuo a partir do dia em que você liga, e esse é o R\$ 970 do card.

## O que a 5PI cobra de você

Antes de falar de contrato, é preciso entender onde o teste reprova. Estas são as regras que mudam a forma de configurar o robô.

### A meta é igual ao limite de perda

No Book 2k você precisa ganhar **R\$ 2.000** e não pode perder **R\$ 2.000**. Em termos práticos: você precisa de uma estratégia cujo recuo caiba **com folga** dentro da meta.

### Regra de consistência: nenhum dia pode valer mais de 50% do lucro

Se você fizer R\$ 2.000 e um único dia tiver feito R\$ 1.200, **você bateu a meta e mesmo assim não passa**. Essa é a regra que mais derruba quem opera com muito contrato, e a próxima página mostra exatamente por quê.

### Mínimo de pregões operados

São aceitos **5 dias operados com 3 no positivo**, ou **10 dias operados com 5 no positivo**. Ninguém passa em dois dias, mesmo acertando a mão.

### Day trade, zerado antes do fechamento

Não pode carregar posição. As posições precisam estar encerradas **30 minutos antes do fechamento da B3**. Os cinco robôs do COMBO já são day trade e já têm horário de encerramento.

### Sem copy trade, no máximo 2 contas simultâneas

O COMBO roda direto no seu Profit, na conta de teste. **Não é copy invest**, então está dentro da regra.

### O teste é em conta simulador

Nenhum centavo seu vai para o mercado durante o teste. **O único investimento é a taxa do plano**, e a automação sai de graça no simulador. A página 9 explica.

#### DEPOIS DA APROVAÇÃO

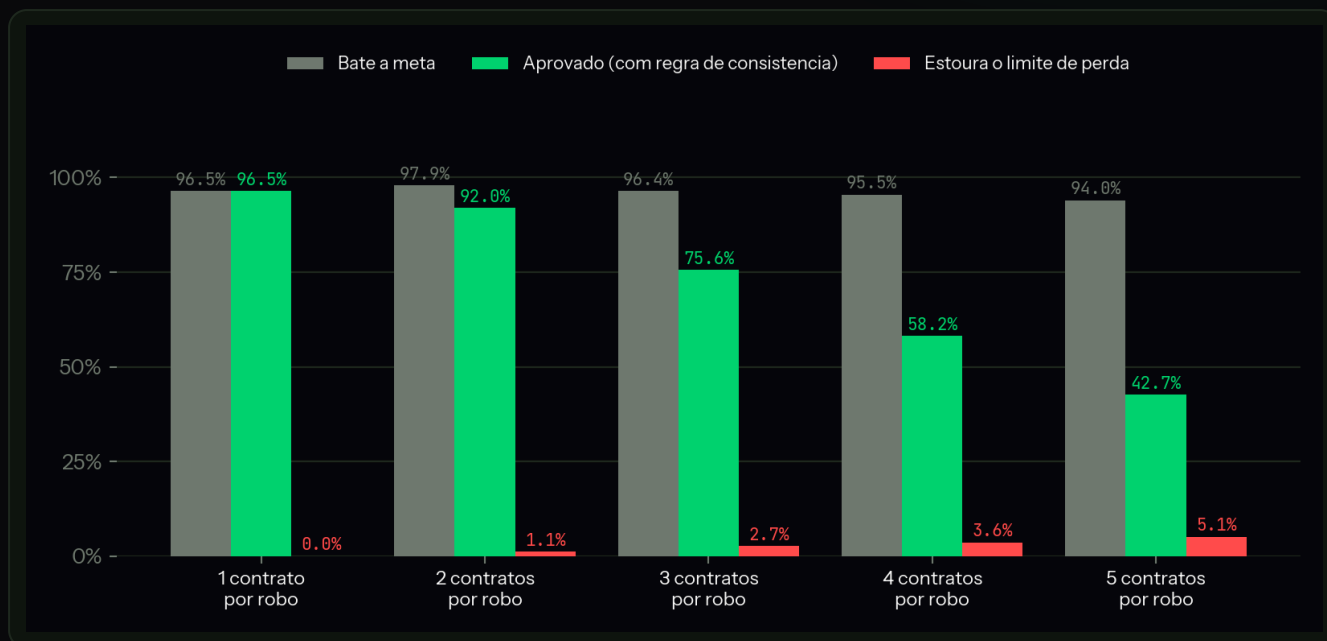
### Repasse de 90% do resultado

O teste é o gargalo, não a operação. Por isso vale mais **passar devagar e com segurança** do que tentar passar rápido e queimar a taxa do plano.

Fonte: regulamento oficial da 5PI. Confira sempre a versão vigente antes de contratar, porque a mesa atualiza as regras periodicamente.

## Quantas vezes o COMBO passa no teste

Peguei os 1.226 pregões de histórico e simulei o teste do Book 2k começando em **todas as datas possíveis** da janela. São 1.226 testes independentes. Para cada um, verifiquei se bateu a meta, se estourou o limite de perda e se respeitou a regra dos 50%.



Book 2k - meta R\$ 2.000 - perda máxima R\$ 2.000 - sem prazo. A barra verde já desconta os testes que bateram a meta mas **foram reprovados pela regra de consistência**.

| CONTRATOS POR ROBÔ | EXPOSIÇÃO | BATE A META | APROVADO | ESTOURA O STOP | MEDIANA DE PREGÕES |
|--------------------|-----------|-------------|----------|----------------|--------------------|
| 1 contrato         | 5         | 96,5%       | 96,5%    | 0,0%           | 59                 |
| 2 contratos        | 10        | 97,9%       | 92,0%    | 1,1%           | 29                 |
| 3 contratos        | 15        | 96,4%       | 75,6%    | 2,7%           | 20                 |
| 4 contratos        | 20        | 95,5%       | 58,2%    | 3,6%           | 14                 |
| 5 contratos        | 25        | 94,0%       | 42,7%    | 5,1%           | 11                 |

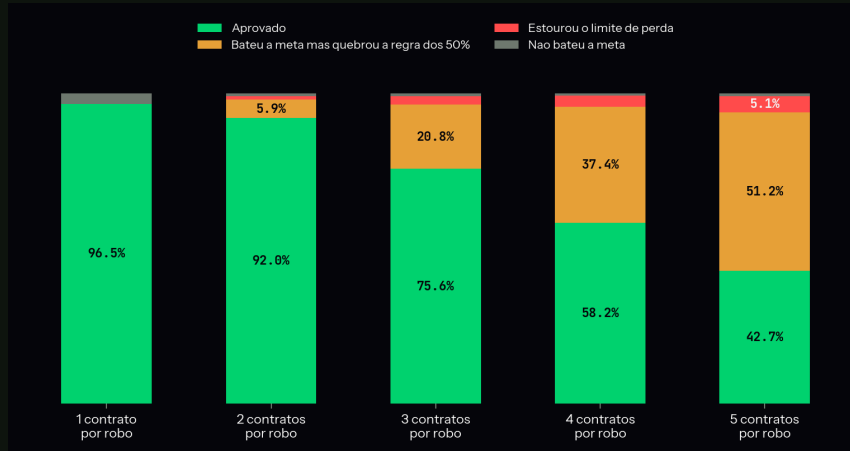
### A RECOMENDAÇÃO

#### 2 contratos por robô no Book 2k

É o melhor ponto entre velocidade e segurança: **92% de aprovação**, com mediana de **29 pregões**. Com 1 contrato a aprovação é um pouco maior, mas o teste leva o dobro do tempo. A partir de 3 contratos a aprovação despenca, e a página seguinte explica o motivo.

# Aumentar contrato **não acelera a aprovação**

Com mais contrato o robô **bate a meta quase sempre**, em qualquer configuração. O que muda é o que acontece **no caminho** até ela. Veja para onde vai cada teste:



Destinados 1.226 testes simulados em cada configuração. A faixa verde é o que interessa. Repare que a barra cinza (não bateu a meta) quase não existe: **o problema nunca é falta de lucro**.

## 1. A meta é fixa. O seu dia, não.

A meta do Book 2k é **R\$ 2.000 em qualquer configuração**. Com 2 contratos, um dia bom rende uns R\$ 600 e você precisa de vários dias para fechar a meta. Com 5 contratos, esse mesmo dia rende R\$ 1.500, que sozinho já é **75% da meta inteira**. E aí cai na regra: nenhum dia pode valer mais de 50% do lucro. **Você bate a meta e é reprovado.**

## 2. Menos dias operados significa cada dia pesando mais

Com 2 contratos a mediana é de 29 pregões e o melhor dia dilui no meio de dezenas de outros. Com 5 contratos a mediana cai para 11. **Menos dias, cada um com peso maior**. É por isso que a faixa âmbar do gráfico cresce de 5,9% para 51,2%.

## 3. O limite de perda também é fixo

Dobrar o contrato dobra o recuo, mas **o limite continua em R\$ 2.000**. O recuo típico sai de R\$ 970 com 2 contratos para R\$ 2.028 com 5, ou seja, passa do limite. A faixa vermelha sobe de 1,1% para 5,1%.

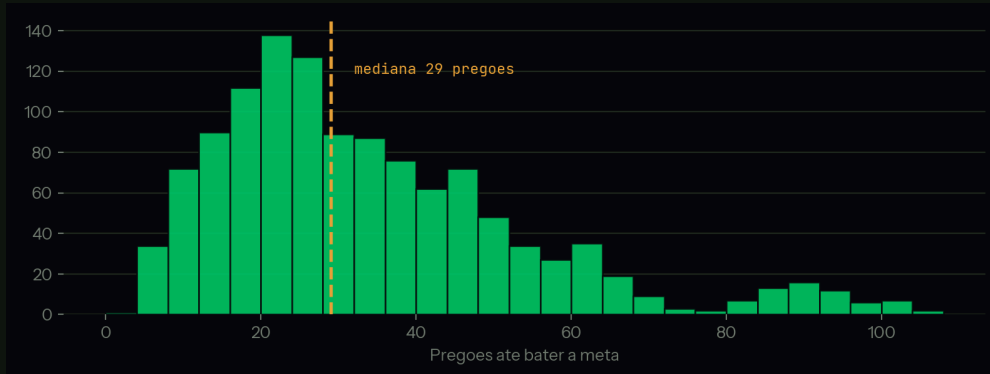
### RESUMINDO

#### Contrato alto é uma troca ruim neste teste

Você paga com **risco de reprovação** para comprar velocidade que a mesa não recompensa. **A mesa não paga quem passa rápido, paga quem passa.**

## Quanto tempo leva e o cuidado dos 50%

Com 2 contratos, metade dos testes fecha a meta em **29 pregões**. Não é um teste de uma semana, e isso é proposital.



Distribuição do número de pregões até bater a meta, Book 2k com 2 contratos por robô. **25% em até 19 pregões · 50% em até 29 · 75% em até 44 · 90% em até 61.**

### O que fazer quando um dia vem forte demais

- 1 Acompanhe o **maior dia** e o **lucro acumulado**. Enquanto o maior dia passar de 50% do acumulado, você ainda não pode encerrar o teste.
- 2 Se acontecer, **continue operando normalmente** além da meta. Cada novo dia positivo dilui o peso daquele dia grande.
- 3 Nunca aumente contrato para "terminar logo". É exatamente esse movimento que transforma um teste que ia passar em um teste reprovado.
- 4 Respeite o mínimo de dias: **5 operados com 3 positivos** ou **10 operados com 5 positivos**.

#### SE O SEU PLANO TIVER PRAZO

#### Com prazo de 60 dias corridos a recomendação segue em 2 contratos

Nessa janela, 2 contratos aprova em **65,6%** e 3 contratos em **67,6%**: praticamente empatados, e 3 contratos carrega mais que o dobro de risco de stop. **Se o seu plano tiver prazo, me chama antes de configurar** para a gente olhar o caso.

## Quantos contratos em cada plano

O portfólio foi montado para meta de R\$ 2.000. Como o sistema é linear, para os planos maiores basta multiplicar: **contratos por robô = meta ÷ 1.000**. As estatísticas de aprovação são as mesmas da página 5, porque a proporção entre risco e meta não muda.

| PLANO    | EXPOSIÇÃO MÁX. | META       | PERDA MÁX. | CONTRATOS POR ROBÔ | EXPOSIÇÃO USADA | RECUO TÍPICO (P95) |
|----------|----------------|------------|------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Book 2k  | 15             | R\$ 2.000  | R\$ 2.000  | 2                  | 10 de 15        | R\$ 970            |
| Book 4k  | 30             | R\$ 4.000  | R\$ 4.000  | 4                  | 20 de 30        | R\$ 1.940          |
| Book 6k  | 45             | R\$ 6.000  | R\$ 6.000  | 6                  | 30 de 45        | R\$ 2.910          |
| Book 8k  | 60             | R\$ 8.000  | R\$ 8.000  | 8                  | 40 de 60        | R\$ 3.880          |
| Book 10k | 75             | R\$ 10.000 | R\$ 10.000 | 10                 | 50 de 75        | R\$ 4.850          |
| Book 15k | 115            | R\$ 15.000 | R\$ 15.000 | 15                 | 75 de 115       | R\$ 7.275          |
| Book 18k | 135            | R\$ 18.000 | R\$ 18.000 | 18                 | 90 de 135       | R\$ 8.730          |
| Book 25k | 190            | R\$ 25.000 | R\$ 25.000 | 25                 | 125 de 190      | R\$ 12.125         |
| Book 30k | 230            | R\$ 30.000 | R\$ 30.000 | 30                 | 150 de 230      | R\$ 14.550         |
| Book 50k | 385            | R\$ 50.000 | R\$ 50.000 | 50                 | 250 de 385      | R\$ 24.250         |

Exposição usada = contratos por robô x 5 robôs. Recuo típico (p95) = em 95% dos testes simulados o recuo máximo a partir do início ficou **abaixo desse valor**, o que dá pouquinho menos da metade do limite de perda do plano.

### COMO LER A TABELA

#### A exposição sempre cabe, com folga

No Book 2k você usa **10 dos 15 contratos** permitidos. Sobra margem sem estourar o limite da mesa. Essa folga existe em todos os planos e é proposital.

### O QUE NÃO FAZER

#### Não arredonde para cima

Se der vontade de colocar 3 contratos no Book 2k porque "cabe na exposição", lembre da página 6: **a aprovação cai de 92,0% para 75,6%** e você não ganha nada com isso, porque a mesa exige um mínimo de dias operados de qualquer forma.

## Módulo de automação: só depois de passar

Esta é a boa notícia que muita gente não sabe. O teste da 5PI é feito em conta simulador, e nos planos Profit Ultra e Profit Pro a automação de estratégias já vem liberada de graça para conta de simulação. Ou seja: **você faz o teste inteiro sem contratar módulo nenhum.**

### DURANTE O TESTE

#### Custo de automação: zero

Basta ter o **Profit Ultra** ou o **Profit Pro**. Os 5 robôs do COMBO rodam na conta simulador da mesa sem nenhuma contratação extra. O **único investimento do teste é a taxa do plano da 5PI.**

### DEPOIS DA APROVAÇÃO

#### Aí sim o módulo precisa ser contratado

Quando a conta vira real, a automação passa a ser paga. O módulo é vendido por **limite de exposição**, e o detalhe que pega muita gente é este: **a plataforma conta a exposição de toda automação ligada, mesmo que ela esteja sem posição.** WIN e WDO somam no mesmo limite, então a conta é simples: **contratos por robô x 5.**

| VERSÃO DO MÓDULO         | EXPOSIÇÃO<br>BM&F (MINI) | CONTRATOS<br>CHEIOS | ATENDE ATÉ         | QUANDO CONTRATAR                      |
|--------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------|---------------------------------------|
| Automação de Estratégias | 5                        | 0                   | 1 contrato/robô    | Não atende a configuração recomendada |
| Plus                     | 50                       | 10                  | 10 contratos/robô  | Book 2k até Book 10k                  |
| Premium                  | 250                      | 50                  | 50 contratos/robô  | Book 15k até Book 50k                 |
| Premium 500              | 500                      | 100                 | 100 contratos/robô | Acima do maior plano da 5PI           |
| Premium 1.000            | 1.000                    | 200                 | 200 contratos/robô | Acima do maior plano da 5PI           |

Fonte: central de ajuda da Nelógica, tabela de contratação do módulo Automação de Estratégias. Confirme os limites e as condições vigentes na NeloStore antes de contratar.

### RESUMO

#### Teste sem custo de módulo, conta aprovada como Plus

No teste você não paga nada de automação. Depois de aprovado, com 2 contratos por robô o Profit enxerga **10 contratos de exposição** o tempo inteiro, e o **Plus** (50 minicontratos) cobre isso com folga. **A versão base, de 5 contratos, não atende:** ela só permitiria 1 contrato por robô.

## Checklist do COMBO 5PI

Passe o olho antes de começar o teste.

- ☐ Tenho **Profit Ultra ou Profit Pro**, que já libera a automação de graça na conta simulador
- ☐ Os **5 robôs** estão importados, com validade em dia e ligados na conta da mesa
- ☐ Configurei **meta ÷ 1.000 contratos por robô** e conferi a exposição total
- ☐ Entendi que **aumentar contrato reduz a chance de aprovação** e não acelera nada de útil
- ☐ Vou acompanhar a **regra dos 50%**: nenhum dia pode valer mais da metade do lucro acumulado
- ☐ Vou cumprir o mínimo de **5 dias operados com 3 positivos** (ou 10 com 5)
- ☐ Sei que os robôs **zeram antes do fechamento** e que não posso carregar posição
- ☐ Sei que o **módulo de automação só é contratado depois de aprovado**, quando a conta vira real

### O QUE JÁ ESTÁ NOS NÚMEROS

#### Emolumentos e execução real, sim. Corretagem, não.

Os resultados deste material **já descontam emolumentos e o deságio de execução**, e as cinco estratégias **foram validadas em conta real**, então a diferença entre backtest e execução de verdade já está refletida nas curvas. **O único custo que não entra é a corretagem**, porque ela muda de corretora para corretora.

### AVISO IMPORTANTE

#### Resultado passado não é promessa de resultado futuro

O mercado muda e nenhuma configuração garante aprovação. Operar em mesa proprietária envolve risco e **a taxa do plano pode ser perdida. Isto é uma recomendação de configuração, não uma promessa.**

### DÚVIDA ANTES DE CONFIGURAR?

#### Me chama no direct

Principalmente se o seu plano tiver **prazo para conclusão**: nesse caso vale olhar o caso junto.

@frantiescotrader