

NEXTRADER

ROBÔ PACKAGEULTRA

MANUAL TÉCNICO DE PARÂMETROS // MINI ÍNDICE

ARQUITETURA OPERACIONAL

Janelas de negociação • Grid flexível • Limites financeiros • Drawdown estático e dinâmico • Saída única • Escalonamento de contratos

Documento de referência para compreender o efeito de cada parâmetro da configuração fornecida. Os exemplos explicam a lógica operacional; o comportamento final depende das regras internas do código, da corretora, da plataforma, da liquidez e das condições de mercado.

01 // VISÃO GERAL

O **PackageUltra** foi configurado como um robô de Mini Índice com foco em controle de horário, execução por ordens limitadas, grade de preço, limites financeiros por operação e por sessão, além de gerenciamento de drawdown de ganho em múltiplos níveis. A configuração atual trabalha com 1 contrato por nível, distância de 50 pontos e alvo de 50 pontos.

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
_0910_as_1200	Padrão	Preset operacional principal.
HoraZeragem	12:00	Encerramento programado da exposição.
UsarOrdens_Limit	true	Execução por ordens limitadas.
GridTotal	true	Estrutura completa do grid enviada conforme a lógica do robô.
DistanciaGradePts	50	Espaçamento entre níveis.
AlvoPts	50	Objetivo de preço.
QTD_Niveis	20	Quantidade de níveis autorizados.
Contratos	1	Quantidade base da entrada.
LimiteGain / LimiteLoss	R\$ 500 / R\$ 500	Travas financeiras globais.

02 // HORÁRIOS, INTERVALOS E ZERAGEM

Este bloco define quando o robô pode operar e quando deve encerrar a exposição.

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
_0910_as_1200	"Padrão"	Preset principal de horário, associado à faixa de 09:10 a 12:00 conforme a implementação.
HoraZeragem	12:00	Horário de zeragem. Serve para impedir que a estratégia carregue posição além do período planejado.
HabIntervalo1	false	Janela 1 desabilitada.
HoraInicio1 / HoraFim1	09:10 / 09:25	Faixa da janela 1.
HabIntervalo2	false	Janela 2 desabilitada.
HoraInicio2 / HoraFim2	09:36 / 09:55	Faixa da janela 2.
HabIntervalo3	false	Janela 3 desabilitada.
HoraInicio3 / HoraFim3	10:05 / 10:20	Faixa da janela 3.
HabIntervalo4	false	Janela 4 desabilitada.
HoraInicio4 / HoraFim4	10:34 / 10:55	Faixa da janela 4.
HabIntervalo5	false	Janela 5 desabilitada.

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
Horainicio5 / HoraFim5	11:05 / 12:00	Faixa da janela 5.
HabIntervalo6	false	Janela 6 desabilitada.
Horainicio6 / HoraFim6	12:10 / 16:00	Faixa adicional; sua utilização deve ser coerente com HoraZeragem.

Leitura atual: como todos os HabIntervalo estão em false, as seis janelas individuais não estão habilitadas. O preset principal e a rotina ligada à HoraZeragem são os elementos centrais da sessão.

03 // MOTOR DE EXECUÇÃO

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
UsarOrdens_AtMarket	false	Desativa ordens a mercado. Evita priorizar execução imediata pelo melhor preço disponível.
UsarOrdens_Limit	true	Ativa ordens limitadas. Dá controle de preço, mas a ordem pode não executar.
GridTotal	true	Envia todas as ordens previstas da grade de uma vez, conforme a lógica implementada.
OrdensPendentesMax	1	Limita pendências quando GridTotal=false. Com GridTotal=true, não é o controlador principal da grade.

Market x Limit: Market favorece execução, porém pode sofrer slippage. Limit favorece preço, mas depende de negociação no nível e prioridade na fila.

04 // LIMITES FINANCEIROS

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
LimiteGain	R\$ 500	Teto de ganho acumulado da sessão.
LimiteInfGain	R\$ 450	Faixa inferior associada ao limite de ganho. A ação exata depende da lógica interna.
LimiteLoss	R\$ 500	Teto de perda acumulada da sessão.
GainMaximo_Operacao	R\$ 490	Limite de ganho de uma operação/ciclo individual.
StopMaximo_Operacao	R\$ 490	Limite de perda de uma operação/ciclo individual.

A separação é importante: **LimiteGain/LimiteLoss** são controles globais; **GainMaximo_Operacao/StopMaximo_Operacao** atuam no ciclo individual, se assim implementado no código.

05 // DRAWDOWN DE LOSS

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
HabilitarDrawdown_Loss	false	Proteção de drawdown sobre perda está desligada.
ValorDrawdown_Loss	R\$ 450	Referência que seria utilizada caso o módulo fosse ativado.

06 // DRAWDOWN DE GAIN ESTÁTICO

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
HabilitarDrawdown_Gain_Estático	false	Proteção estática de lucro desativada.
ValorDrawdown_Gain	R\$ 150	Patamar de referência para a proteção estática.

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
PercentualLimit	50%	Percentual utilizado pela fórmula estática do código.

07 // DRAWDOWN DE GAIN DINÂMICO

É o módulo de proteção de lucro habilitado na configuração atual.

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
HabilitarDrawdown_Gain_Dinâmico	true	Ativa o gerenciamento progressivo do lucro.
ValorDrawdown_Gain_nv1	R\$ 100	Primeiro patamar.
PercentualLimit_nv1	80%	Percentual do nível 1.
ValorDrawdown_Gain_nv2	R\$ 150	Segundo patamar.
PercentualLimit_nv2	70%	Percentual do nível 2.
ValorDrawdown_Gain_nv3	R\$ 200	Terceiro patamar.
PercentualLimit_nv3	60%	Percentual do nível 3.
ValorDrawdown_Gain_nv4	R\$ 250	Quarto patamar.
PercentualLimit_nv4	30%	Percentual do nível 4.

Importante: sem o trecho da fórmula que consome PercentualLimit_nv1...nv4, não é seguro afirmar se 80% significa preservar 80% do lucro, permitir devolução de 80% ou outra convenção. Os patamares estão documentados; a interpretação matemática precisa seguir o código-fonte.

08 // GERENCIAMENTO DA GRADE

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
SaidaUnica	true	Utiliza saída consolidada/única para a posição, conforme a implementação.
AlvoPts	50 pontos	Objetivo de lucro em pontos usado pelo gerenciamento.
DistanciaGradePts	50 pontos	Espaçamento entre níveis consecutivos.
QTD_Niveis	20	Número de níveis do grid.
Contratos	1	Quantidade base da entrada inicial.

Com 20 níveis separados por 50 pontos, a malha geométrica pode alcançar **1.000 pontos de distância acumulada** até o 20º nível, caso todos sejam utilizados na mesma direção. Isso não equivale automaticamente a uma perda de 1.000 pontos, pois preço médio, saídas e regras financeiras alteram o resultado.

09 // CONTRATOS POR NÍVEL

Os parâmetros **CtoMedio1** até **CtoMedio40** permitem individualizar a quantidade de contratos por estágio. Na configuração enviada, **todos estão definidos como 1**.

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
CtoMedio1 ... CtoMedio10	1 em todos	Primeiro bloco sem progressão de mão.
CtoMedio11 ... CtoMedio20	1 em todos	Segundo bloco sem progressão de mão.
CtoMedio21 ... CtoMedio30	1 em todos	Terceiro bloco sem progressão de mão.
CtoMedio31 ... CtoMedio40	1 em todos	Quarto bloco sem progressão de mão.

Consequência: não existe martingale por aumento da quantidade unitária nos parâmetros apresentados. A exposição, porém, continua crescendo conforme mais níveis são executados.

10 // MAPA DE EXPOSIÇÃO TEÓRICA

Níveis executados	Contratos nos níveis*	Último nível
1	1	50 pts
2	2	100 pts
5	5	250 pts
10	10	500 pts
15	15	750 pts
20	20	1000 pts

* Ilustração considerando 1 contrato por nível e sem incorporar particularidades da entrada inicial.

11 // COMO CADA AJUSTE MUDA O PERFIL

PARÂMETRO	ATUAL	FUNÇÃO / EFEITO
QTD_Niveis menor	Mais contenção	Reduz a quantidade máxima de níveis que podem acumular posição.
DistanciaGradePts maior	Grade mais espaçada	Os níveis ficam mais distantes e tendem a ser acionados com menor frequência.
DistanciaGradePts menor	Grade mais fechada	A posição pode crescer mais rapidamente em movimentos direcionais.
AlvoPts menor	Saída mais próxima	Reduz a distância do objetivo por ciclo.
CtoMedio acima de 1	Mais exposição	Aumenta risco, margem e sensibilidade financeira dos níveis alterados.
AtMarket=true	Execução prioritária	Pode aumentar slippage; exige entender a prioridade entre Market e Limit no código.

12 // PERFIL ATUAL

PACKAGEULTRA // CONFIGURAÇÃO ATUAL

Operação matinal com zeragem às 12:00, ordens limitadas, grid total, 20 níveis de 50 pontos, 1 contrato por nível, alvo de 50 pontos, limites globais de R\$ 500 e drawdown dinâmico de ganho habilitado.

13 // CHECKLIST PRÉ-OPERAÇÃO

- Confirmar o contrato correto do Mini Índice.
- Verificar preset de horário e HoraZeragem.
- Validar se o modo de ordens ativo corresponde ao comportamento desejado.
- Revisar QTD_Niveis, DistanciaGradePts e contratos por nível antes de alterar o perfil.
- Testar mudanças primeiro em simulação/replay.
- Confirmar no código a matemática exata dos PercentualLimit do drawdown dinâmico.
- Monitorar margem, custos, slippage, rejeições e desconexões da plataforma.

14 // AVISO DE RISCO

Automação não elimina risco. Estratégias de grid podem acumular posição durante movimentos direcionais e sofrer perdas relevantes. Gain, loss, drawdown e quantidade de contratos devem ser compatíveis com capital, margem, custos e tolerância a risco. Este manual documenta os parâmetros enviados e não constitui promessa de rentabilidade ou recomendação de investimento.

