

NEXTRADER

ROBÔ VENON

OPERATIONAL CORE // MANUAL DE PARÂMETROS

VENON // GRID ENGINE

Controle temporal • Grid flexível • Saída única • Ordens Limit • Gestão financeira • Drawdown de gain
• Escalonamento individual por nível

Documentação técnica da configuração apresentada para o Nextrader Robô Venon. O objetivo é explicar o papel de cada parâmetro, a interação entre os módulos e o perfil operacional resultante.

VENON // BUILD DOCUMENTATION 2026

ÍNDICE // SYSTEM MAP

SYS	MÓDULO	PÁG.
01	Visão geral e configuração-base	3
02	Horários, intervalos e zeragem	4
03	Gerenciamento da posição	5
04	Grid, níveis e geometria	6
05	Contratos por nível — CtoMedio	7
06	Motor de execução — Market / Limit	8
07	Grid flexível e ordens pendentes	8
08	Limites financeiros da sessão	9
09	Gain e Stop máximos por operação	9
10	Drawdown de Gain	10
11	Drawdown de Loss	10
12	Mapa de exposição teórica	11
13	Leitura integrada do perfil Venon	12
14	Como os parâmetros alteram o comportamento	13
15	Checklist operacional	14
16	Aviso de risco e notas técnicas	14

Navegação conceitual: **TIME CORE** → **POSITION CORE** → **GRID CORE** → **EXECUTION CORE** → **RISK CORE**.

01 // VISÃO GERAL

O **Venon** é uma arquitetura de grid parametrizável para Mini Índice. Na configuração enviada, ele combina operação matinal, ordens limitadas, grade total, 20 níveis ativos, 50 pontos entre níveis, alvo de 50 pontos e 1 contrato por estágio. O gerenciamento financeiro possui travas globais de R\$ 500 e um módulo de drawdown de gain habilitado.

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
_0910_as_1200	Padrão	Preset temporal principal.
HoraZeragem	12:00	Horário programado para zeragem.
SaidaUnica	true	Saída consolidada da posição.
AlvoPts	50	Objetivo em pontos.
DistanciaGradePts	50	Distância entre níveis.
QTD_Niveis	20	Quantidade de níveis ativos.
Contratos	1	Quantidade base.
GridTotal	true	Grade completa enviada de uma vez.
LimiteGain / Loss	500 / 500	Limites globais de resultado.
Drawdown Gain	Ativo	Proteção de ganho habilitada.

DNA DO VENON: grade simétrica em espaçamento e alvo (50/50), mão unitária e gerenciamento financeiro independente do tamanho máximo permitido por operação.

02 // HORÁRIOS, INTERVALOS E ZERAGEM

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
__("Intervalos")	Separador	Organiza visualmente o bloco de horários na tela de parâmetros.
_0910_as_1200	"Padrão"	Preset de operação principal associado ao período 09:10–12:00.
HoraZeragem	12:00	Horário em que a estratégia deve encerrar exposição conforme sua rotina de zeragem.
HabIntervalo1	false	Janela 1 desativada.
Horalncio1 / HoraFim1	09:10 / 09:25	Janela 1.
HabIntervalo2	false	Janela 2 desativada.
Horalncio2 / HoraFim2	09:36 / 09:55	Janela 2.
HabIntervalo3	false	Janela 3 desativada.
Horalncio3 / HoraFim3	10:05 / 10:20	Janela 3.
HabIntervalo4	false	Janela 4 desativada.
Horalncio4 / HoraFim4	10:34 / 10:55	Janela 4.
HabIntervalo5	false	Janela 5 desativada.
Horalncio5 / HoraFim5	11:05 / 12:00	Janela 5.
HabIntervalo6	false	Janela 6 desativada.
Horalncio6 / HoraFim6	12:10 / 16:00	Janela extra após o período matinal.

STATUS ATUAL: todos os HabIntervalo estão em false. Portanto, essas seis faixas não estão individualmente habilitadas. A janela efetiva depende do preset principal e da lógica interna que o interpreta.

03 // GERENCIAMENTO DA POSIÇÃO

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
SaidaUnica	true	Indica saída consolidada da posição/grid, conforme a rotina implementada.
AlvoPts	50,00 pts	Distância de objetivo usada pelo gerenciamento.
DistanciaGradePts	50 pts	Espaçamento entre entradas adicionais da grade.
QTD_Niveis	20	Máximo de níveis configurados para a grade ativa.
Contratos	1,0	Quantidade base da entrada inicial.

A combinação **AlvoPts = 50** e **DistanciaGradePts = 50** cria uma estrutura 1:1 entre espaçamento da grade e objetivo nominal. Cada novo nível está separado do anterior pela mesma distância utilizada como alvo configurado.

04 // GRID, NÍVEIS E GEOMETRIA

Nível	Distância acumulada	CtoMedio
1	50 pts	1
2	100 pts	1
3	150 pts	1
4	200 pts	1
5	250 pts	1
10	500 pts	1
15	750 pts	1
20	1000 pts	1

Com 20 níveis × 50 pontos, a **extensão geométrica teórica** até o 20º nível é de 1.000 pontos. Isso descreve distância de grade, não prejuízo financeiro automático.

05 // CONTRATOS POR NÍVEL — CTOMEDIO

O Venon oferece parâmetros individuais de **CtoMedio1** até **CtoMedio40**. Isso permite criar progressões personalizadas de mão. Na configuração atual, todos os 40 parâmetros estão em 1.

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
CtoMedio1–10	1	Níveis 1 a 10: mão unitária.
CtoMedio11–20	1	Níveis 11 a 20: mão unitária.
CtoMedio21–30	1	Níveis 21 a 30: mão unitária.
CtoMedio31–40	1	Níveis 31 a 40: mão unitária.

Embora existam 40 campos CtoMedio, **QTD_Niveis está em 20**. Portanto, na configuração apresentada, os parâmetros acima do nível 20 ficam fora da quantidade de níveis atualmente autorizada, salvo se outra parte do código os utilizar para finalidade diferente.

SEM PROGRESSÃO DE MÃO: com todos os CtoMedio em 1, não há multiplicação crescente de contratos parametrizada. O risco aumenta pelo acúmulo de níveis, não pelo aumento unitário de cada novo nível.

06 // MOTOR DE EXECUÇÃO — MARKET / LIMIT

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
UsarOrdens_AtMarket	false	Desativa envio prioritário a mercado.
UsarOrdens_Limit	true	Ativa ordens limitadas, buscando execução em preços definidos.

Limit reduz a incerteza do preço solicitado, mas não garante preenchimento. Em movimentos rápidos, a ordem pode permanecer pendente ou perder prioridade. **AtMarket**, se ativado, favorece execução imediata, porém fica mais exposto a slippage.

07 // GRID FLEXÍVEL E ORDENS PENDENTES

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
GridTotal	true	Envia todas as ordens previstas da grade de uma vez, de acordo com a implementação.
OrdensPendentesMax	3	Quando GridTotal=false, permite limitar a quantidade de ordens pendentes simultâneas a três.

NA CONFIGURAÇÃO ATUAL: GridTotal=true. Assim, OrdensPendentesMax=3 foi preparado para o modo flexível, mas tende a ganhar relevância somente quando GridTotal for alterado para false.

08 // LIMITES FINANCEIROS DA SESSÃO

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
LimiteGain	R\$ 500	Limite superior de ganho acumulado da sessão.
LimiteInfGain	R\$ 450	Faixa inferior ligada ao gerenciamento do gain global. A ação exata depende da rotina interna.
LimiteLoss	R\$ 500	Limite global de perda da sessão.

Esses parâmetros formam o **Risk Core global**: acompanham o resultado agregado da sessão e não devem ser confundidos com o limite de uma única operação.

09 // GAIN E STOP MÁXIMOS POR OPERAÇÃO

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
GainMaximo_Operacao	R\$ 1.000	Teto configurado para ganho de um ciclo/operação individual.
StopMaximo_Operacao	R\$ 1.000	Teto configurado para perda de um ciclo/operação individual.

RELAÇÃO IMPORTANTE: os limites por operação estão em R\$ 1.000, enquanto o LimiteGain e o LimiteLoss globais estão em R\$ 500. Na prática, a trava global pode ser alcançada antes do teto individual. A precedência real depende da ordem das verificações no código.

10 // DRAWDOWN DE GAIN

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
HabilitarDrawdown_Gain	true	Ativa a proteção de resultado positivo.
ValorDrawdown_Gain	R\$ 250	Patamar financeiro de referência do módulo.
PercentualLimit	50%	Percentual utilizado pela regra de proteção de gain.

Este bloco está **ativo**. A intenção funcional é proteger parte do resultado após o robô atingir a condição de ganho definida. Entretanto, para afirmar exatamente se o PercentualLimit de 50% representa retenção de 50%, devolução máxima de 50% ou outro cálculo, é necessário conferir a fórmula executora no código.

11 // DRAWDOWN DE LOSS

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
HabilitarDrawdown_Loss	false	Módulo de drawdown de perda desativado.
ValorDrawdown_Loss	R\$ 450	Referência preparada para o módulo caso ele seja habilitado.

Como **HabilitarDrawdown_Loss=false**, ValorDrawdown_Loss=450 permanece parametrizado, porém não deve atuar enquanto a chave estiver desligada.

12 // MAPA DE EXPOSIÇÃO TEÓRICA

Níveis preenchidos	Contratos nos níveis*	Distância acumulada
1	1	50 pts
2	2	100 pts
3	3	150 pts
5	5	250 pts
10	10	500 pts
15	15	750 pts
20	20	1000 pts

* Demonstração simples de 1 contrato por nível. A exposição real depende de como a entrada inicial é contabilizada e de quais níveis foram efetivamente executados.

O ponto crítico de qualquer grid é que o **preço médio se desloca à medida que novos níveis são adicionados**. Isso pode aproximar uma saída de recuperação, mas simultaneamente aumenta a exposição financeira total. Por isso, quantidade de níveis, distância e contratos precisam ser analisados em conjunto.

13 // LEITURA INTEGRADA DO PERFIL VENON

Módulo	Configuração	Leitura
TIME CORE	09:10–12:00	Foco operacional matinal
EXECUTION CORE	Limit	Controle de preço de execução
GRID CORE	20 × 50 pts	Grade extensa e uniforme
POSITION CORE	1 contrato/nível	Acúmulo linear
TARGET CORE	50 pts	Alvo igual ao espaçamento
SESSION RISK	± R\$ 500	Trava global simétrica
OPERATION CAP	± R\$ 1.000	Teto individual acima do global
PROFIT DEFENSE	DD Gain ativo	Proteção de resultado habilitada

VENON PROFILE: configuração orientada a grid linear, sem progressão de contratos, com execução Limit e proteção de gain habilitada.

14 // COMO ALTERAÇÕES MUDAM O COMPORTAMENTO

PARÂMETRO	VALOR	FUNÇÃO
QTD_Niveis ↓	Menor profundidade	Reduz o número máximo de níveis que podem acumular posição.
QTD_Niveis ↑	Maior profundidade	Amplia a capacidade da grade, mas também a exposição potencial.
DistanciaGradePts ↑	Mais espaçado	Níveis mais distantes; menor velocidade de acumulação em oscilações curtas.
DistanciaGradePts ↓	Mais fechado	Mais níveis podem ser acionados rapidamente em movimento adverso.
AlvoPts ↓	Objetivo curto	Saída nominal mais próxima.
AlvoPts ↑	Objetivo longo	Exige maior deslocamento favorável para alcançar o alvo.
CtoMedio ↑	Exposição maior	Eleva sensibilidade financeira e margem nos níveis alterados.
GridTotal=false	Grade progressiva	OrdensPendentesMax passa a controlar quantas pendências ficam simultaneamente expostas.
AtMarket=true	Mais execução	Aumenta chance de preenchimento, mas também o risco de slippage.

15 // CHECKLIST OPERACIONAL

- Confirmar ativo e vencimento correto do Mini Índice.
- Verificar preset, intervalos e HoraZeragem.
- Confirmar UsarOrdens_Limit=true e AtMarket=false, se esse for o perfil desejado.
- Revisar GridTotal e OrdensPendentesMax antes de alternar o modo de grade.
- Conferir QTD_Niveis, DistanciaGradePts, AlvoPts e todos os CtoMedio alterados.
- Validar LimiteGain, LimiteLoss e limites máximos por operação.
- Testar alterações em simulação/replay antes do ambiente real.
- Observar margem, slippage, fila de ordens, rejeições e conectividade.

16 // AVISO DE RISCO E NOTAS TÉCNICAS

Estratégias automatizadas e grids podem acumular exposição rapidamente em mercados direcionais. Stops financeiros, drawdowns e limites de sessão reduzem risco, mas não eliminam gaps, slippage, falhas de conexão, rejeições ou eventos de alta volatilidade. Os parâmetros devem ser compatíveis com capital, margem e tolerância de risco.

Este documento descreve a configuração fornecida. Onde a interpretação depende da fórmula interna — especialmente PercentualLimit, LimiteInfGain e precedência entre travas globais e individuais — o manual sinaliza explicitamente a necessidade de confirmação no código-fonte, evitando atribuir ao robô uma lógica que não foi apresentada.

NEXTRADER // VENON // END OF SYSTEM MANUAL