L&S | Educação

TRADER ESTRATEGISTA

Alexandre Wolwacz - Stormer

Introdução:

Obter resultados consistentes no mercado de renda variável talvez seja uma das tarefas mais complexas que um ser humano decida realizar.

Isto porque a imensa quantidade de variáveis a serem observadas, atrelada ao próprio efeito aleatório de curtíssimo prazo percebido neste mercado tornam a atividade brutalmente cansativa e difícil.

A análise técnica em si é apenas uma ferramenta. Podemos conhecer muito bem uma ferramenta, mas se não detivermos a habilidade no seu uso, pouco resultado útil pode ser depreendido.

Imagine que você conheça um bisturi, que você saiba as diferentes laminas que existem, os desenhos de cabos e o material que foi moldado. Isto não significa que imediatamente saberá realizar uma cirurgia com a precisão e técnicas necessárias.

Desta forma, conhecer análise técnica, saber como funciona e de que maneira os gráficos são construídos não garante de forma alguma que um Trader seja vitorioso no mercado.

Precisamos aliar a ferramenta certa à técnica correta. O Bisturi ao conhecimento de como emprega-lo. A análise técnica precisa ser aliada ao conhecimento de como utilizá-la.

Para isto, desenvolvemos este treinamento. Durante anos, treinamos as pessoas em todos os mais detalhados conceitos de análise técnica. Vimos pessoas com bons conhecimentos em AT, não conseguirem resultados consistentes. E decidimos que isto precisa ser encerrado aqui.

Criamos regras, planos e métodos para saber deslocar as peças do nosso jogo de forma eficiente até a obtenção das nossas metas.

Primeira Parte:

Como separar o trigo do Joio:

A análise técnica não é a melhor ferramenta para identificar as boas empresas. Disso, todos nós sabemos. Mas ela pode e nos oferece boas ideias sobre quais são as empresas que apresentam a maior força de compra ou de venda no momento.

Isto é fundamental que seja entendido pelo Trader mais profissional:

VOCE NÃO PRECISA OPERAR todos os dias, nem todos os ativos, nem todos os momentos.

VOCE PODE E DEVE esperar pelos melhores ativos, nos melhores momentos e nos pontos mais exatos.

Desta forma, e com esse conceito em mente, compreenda que você deverá posicionar seu capital apenas em ativos que estejam em pontos ideais de tomada de posição e completamente direcionais.

Existem três formas que permitem que você identifique rapidamente os melhores ativos a serem operados:

A primeira forma chama-se força relativa.

Basicamente consiste em comparar a amplitude de movimentação percentual que o IBOVESPA realizou em um determinado período contra a amplitude de movimentação percentual que os mais diversos ativos executaram neste mesmo período.

Exemplo: suponhamos que o mercado tenha nos últimos 25 dias caído 5%.

Você começa a olhar sua lista e vê 5 ativos:

Vale5, no mesmo período, -8,9%

Itub4, no mesmo período, -4,5%

Vivt4, no mesmo período, 0,5%.

Radl3, no mesmo período, 6,5%

Cvcb3 no mesmo período, 2,4%.

Claramente nesta lista podemos ver quais são os ativos mais fortes que o IBOVESPA e quais são os mais fracos. Quando pensamos ou identificamos que o IBOVESPA possa subir, os ativos que subirão mais serão justamente aqueles que durante a queda do IBOVESPA, caíram MENOS. Posto que nas quedas foram fracos recuos, as altas a seguir devem subir mais que o índice.

Dessa forma, se o IBOVESPA subir 10% a partir deste momento, se eu tivesse que escolher um único ativo para comprar, seria justamente a radl3, posto que ela é a mais forte frente ao IBOVESPA.

As pessoas, por senso comum, tendem a comprar justamente aquelas que caíram mais, acreditando que elas têm um "upside" maior, uma chance de subir mais. Esquecem que elas caíram mais justamente por serem fracas, patéticas, desacreditadas.

Ao localizar os ativos com maior força relativa, iremos operar estes na compra e os mais fracos apenas na venda.

Procurando os sinais de compra ou de venda, considerando sua condição em relação ao benchmark IBOVESPA.

Infelizmente, a força relativa não se mantem infinitamente. Ativos que eram mais fortes, deixam de ser e passam seus bastões para outros papeis, que assumirão a liderança.

Assim sendo, como em uma corrida de bicicletas, a liderança vai sendo trocada de tempos em tempos. Portanto, precisamos construir um parâmetro de acompanhamento.

Eu defino meu parâmetro como o ativo que teve o melhor desempenho percentual no último ano. Busco os 5-10 melhores e nestes irei trabalhar as compras.

Mas a força relativa em si tem um pequeno defeito, ela demora a localizar uma mudança de tendência.

Por isto, o segundo critério torna-se mais efetivo:

Chamo de critérios de excelência Carolina: é um sistema de localização de ativos em boas tendências. Pode ser usado para localizar boas tendências alta ou boas tendências de baixa.

São três critérios que precisam estar juntos e concordando, para compra no semanal:

1- Média móvel de 20 subindo;
2- Olhos começam no lado esquerdo há seis meses e seguem até o final do gráfico, olhos ascendem em diagonal;
3- Olhos observam última cotação presente. A partir daí deslocam-se para esquerda, NÃO podem encontrar mais do que um topo no seu caminho para esquerda no último ano inteiro.

Se formos usar diário, modificação é o requisito 3. Últimos seis meses são o que importam.

Se formos usar intradiário, muda item 2 para 30 dias de olhos ascendendo e 5 dias no item 3 sem topos incomodando.

Para critérios de excelência na venda:

1- Média móvel caindo.
2- Olhos precisam descer ao seguir os preços desde os últimos 6 meses.
3- Nada do lado esquerdo do gráfico no último ano.

Mesmas mudanças ocorrem para time frames menores.

Se usarmos apenas esses critérios, nossos trades tendem a melhora dramaticamente em termos de nível de acerto e de pay-off.

Bom, agora preciso falar de um ponto importante para o leitor:

Você já deve ter entrado em uma casa onde duas pessoas estavam brigando por pontos de vistas diferentes. O que você sentiu? Uma sensação ruim, uma sensação de dificuldade e peso.

Muito bem, quando você olha um gráfico e a tendência do semanal diz para comprar e a tendência do diário diz para você vender você tem exatamente a mesma situação.

E se acrescentarmos os 60 minutos nos estudos podemos ter ainda outra opinião não congruente e dificultando toda nossa vida.

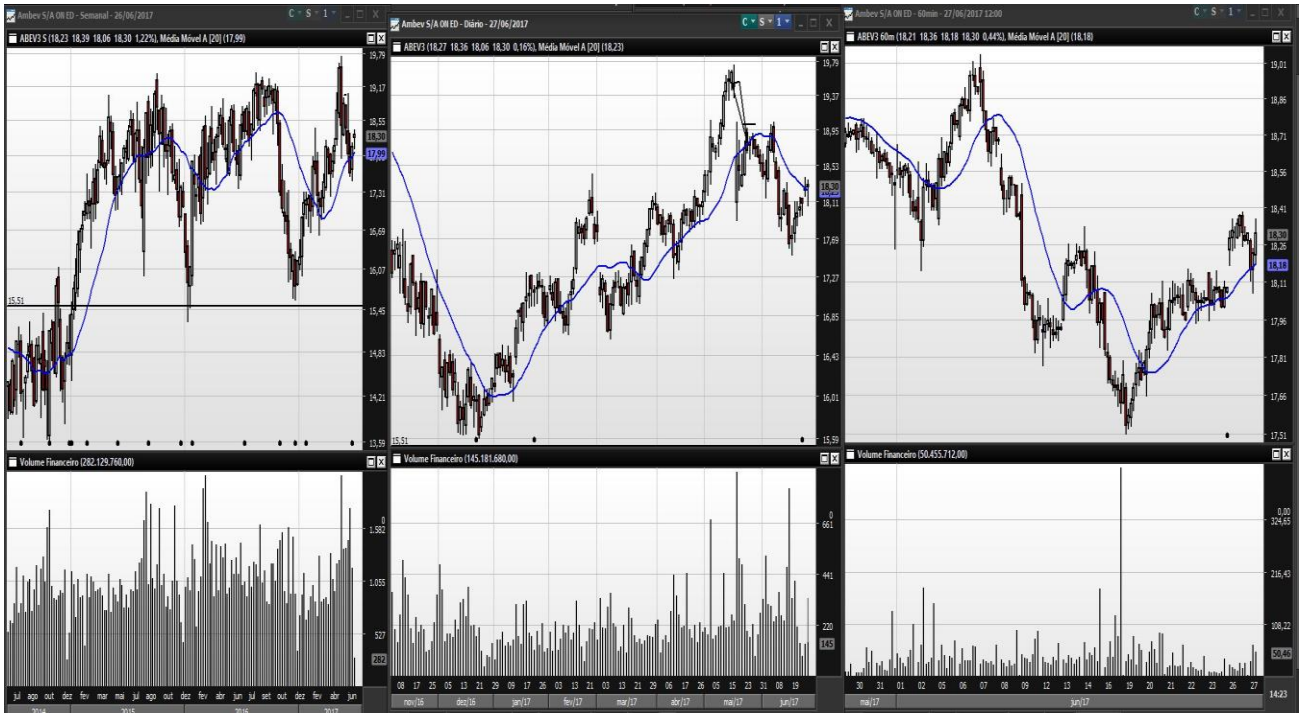
Dessa forma, acostume-se a desenhar em sua tela três times frames do mesmo ativo:



Essa é a situação que procuramos! No semanal, média subindo, no diário média subindo e nos 60 minutos a média também subindo.

Nossas operações ficam muito mais fáceis e simples.

Esperamos que a média dos 60 minutos DISCORDE das médias do diário e do semanal, e depois que ela vire para cima, passando a concordar.



Agora veja que aqui temos o semanal com uma alta, o diário com a média caindo e o 60 minutos temos a média subindo. Aqui temos uma clara situação de briga entre três pessoas.

Melhor ficarmos de fora deste ativo.

Agora observe esse gráfico:



Temos a média semanal e a do diário apontando para baixo. A média de 60 minutos virada para cima. Estamos esperando que esta media vire para baixo, para iniciar nossas vendas.

Segunda Parte:

Bandas de Bollinger

Decidi apresentar essa ferramenta em segundo lugar para que possamos entender as várias possibilidades que ela nos traz. E também utilizar em sua plenitude todas as alternativas que essa versátil ferramenta oferece.

Um Trader estrategista sempre irá utilizar ao máximo o potencial das ferramentas que tem à mão.

Assim sendo vamos entender:

As bandas foram criadas por John Bollinger.

A ideia era ser uma ferramenta auto adaptativa que apresentasse momentos de afastamento fora da curva normal de uma referência móvel, no caso a média móvel ou banda central.

A banda central em si é uma média móvel escolhida pelo Trader.

Sabemos que alguns ativos se adaptam melhor a uma média móvel e outros à outra.

Agora existem duas formas de trabalhar:

Primeira, usar a média de 21 como padrão para todos os ativos e não ajustar os parâmetros por ativo.

Segunda, tentar localizar qual média é mais importante para aquele papel e então ajustar o indicador para este ativo.

O segundo caso é perfeito para quem decidir ser um " Trader especialista".

Eu fortemente recomendo que você pense em ser um Trader especialista.

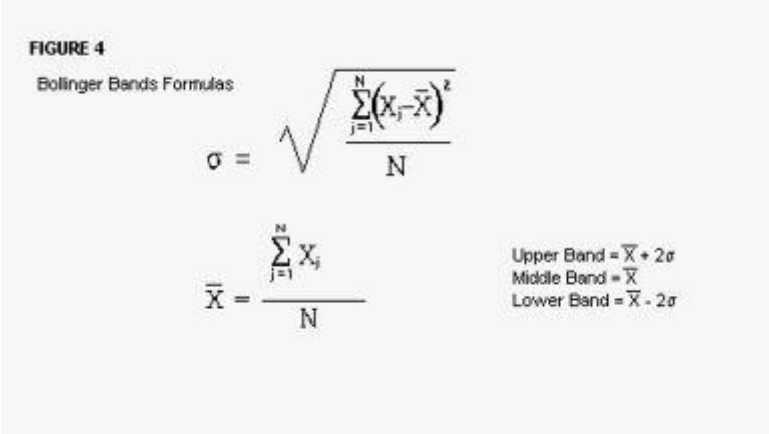
Entenda que nós não teremos capital para operar todos os ativos do mercado ou mesmo se tivermos, podemos decidir operar apenas única e exclusivamente um ativo. E com isso, passaremos a ser um mestre naquele papel rapidamente. Entenderemos qual o melhor indicador, qual a sua tendência, qual a direção, qual

a media, quantos desvios padrões deveríamos usar para o ativo e, mais do que isso, não perderemos nenhum sinal que o ativo nos ofereça.

Isso significaria escolher uma ação ou um ativo e concentrar todos seus olhos para apenas este papel.

Não desfocar sua atenção, nem sua missão.

Que passará a ser assumir todos os sinais bons que este papel oferecer no futuro.



Esta é a formula da Banda de Bollinger. Não precisamos decorá-la. Ela é calculada automaticamente pelos softwares.

Bollinger definiu algumas regras para seu uso:

As regras são usadas, mas eu dei pequenas modificadas.

Os principais conceitos que devemos capturar:

O estreitamento das bandas implica em constrição de volatilidade.

Entendendo volatilidade:

Volatilidade em bolsa significa amplitude de movimentos.
Significa velocidade de movimentos. Portanto diminuição de volatilidade significa movimentos menos amplos e, por conseguinte, menos interessantes para o Trader. Ao passo que uma ampliação da volatilidade é benéfica ao Trader e coloca um possível movimento de ganho como sendo maior.

Dessa forma, queremos nos posicionar ANTES da volatilidade expandir.

Precisamos entender que no mercado para que exista uma expansão de volatilidade, precisamos antes ter uma contração desta.

Como pernas que precisam se encolher antes de dar um salto.

Logo, marque:

Volatilidade diminuindo significa expansão de volatilidade a seguir.

Assim sendo, ao identificar uma banda de Bollinger encolhendo, devemos ficar atentos para a explosão de movimentação que irá ocorrer nos próximos dias.

Um primeiro conceito: ao fechar acima ou abaixo das bandas, podemos e devemos esperar por um movimento contrário ao fechamento observado.

Logo, se visualizarmos um fechamento acima da banda superior da Bollinger, devemos ficar atento a um possível movimento de queda, recuando até a média ou banda central.

Porém detalhe:

Se as bandas estavam se estreitando e tivermos um fechamento acima ou abaixo delas: NÃO opere contra isso.



Observe as bandas de Bollinger se estreitando e o movimento que se seguiu após.

Agora vem um conceito muito importante:

A- Se os preços estiverem entre a banda central e a banda superior, temos uma força de compra dominando e precisamos COMPRAR todos os sinais de compra que ocorrerem.
B- Se os preços estiverem entre a banda central e a banda inferior, temos a força de venda dominando e só poderemos assumir sinais de VENDA.

Agora observe em seguida iremos ver os melhores pontos de entrada e saída em termos de segurança e relação risco benefício e nesse caso iremos associar com essa posição nas bandas de Bollinger.

Mas enquanto não passamos pela parte de pontos de entrada seguros, vamos abordar sistemas isolados que podem ser usados, nos mais diversos time frames.

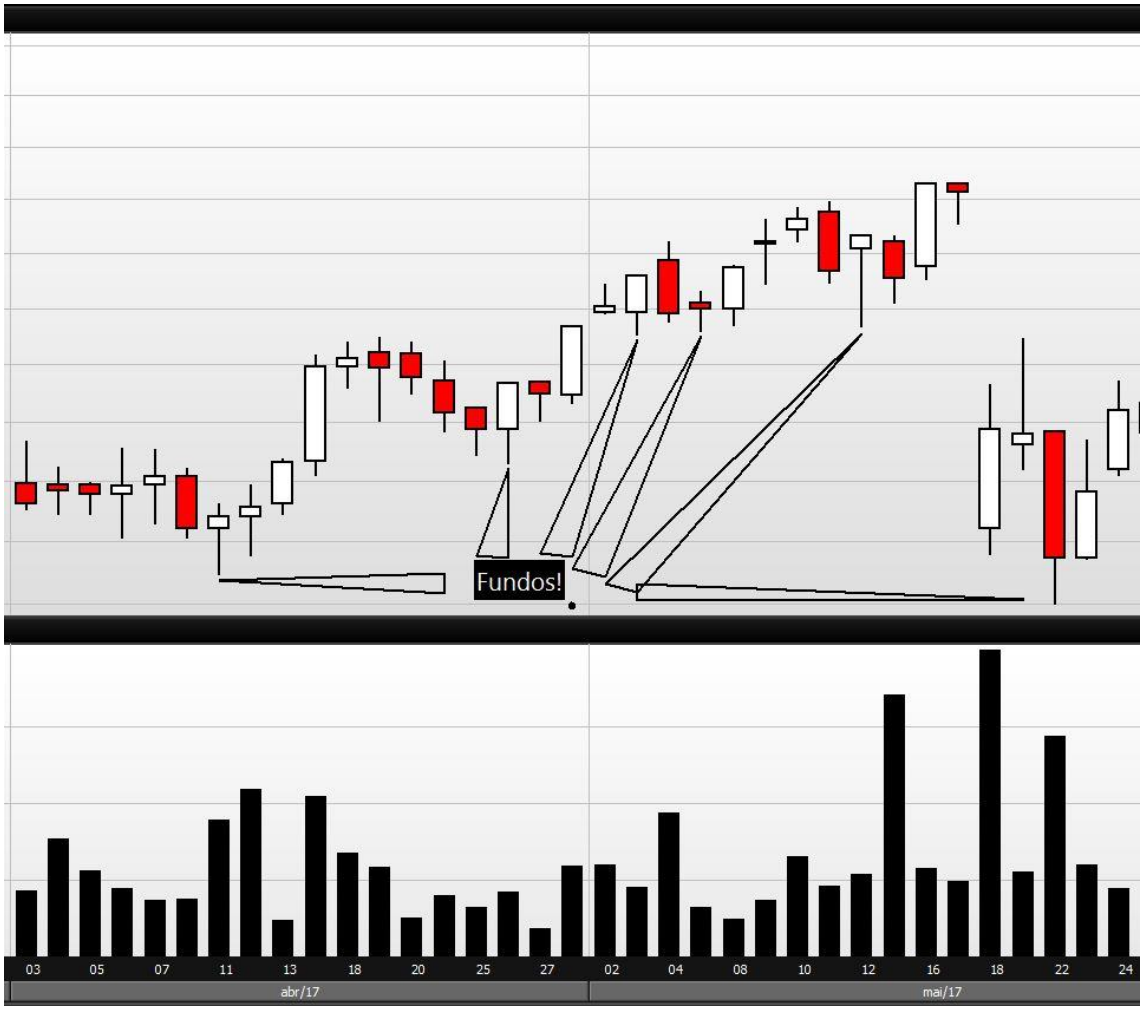
Sistema 1-2-3 e bandas:

Definição desse sistema – SEGUIDOR DE TENDENCIA. Precisa observar a tendência do ativo.

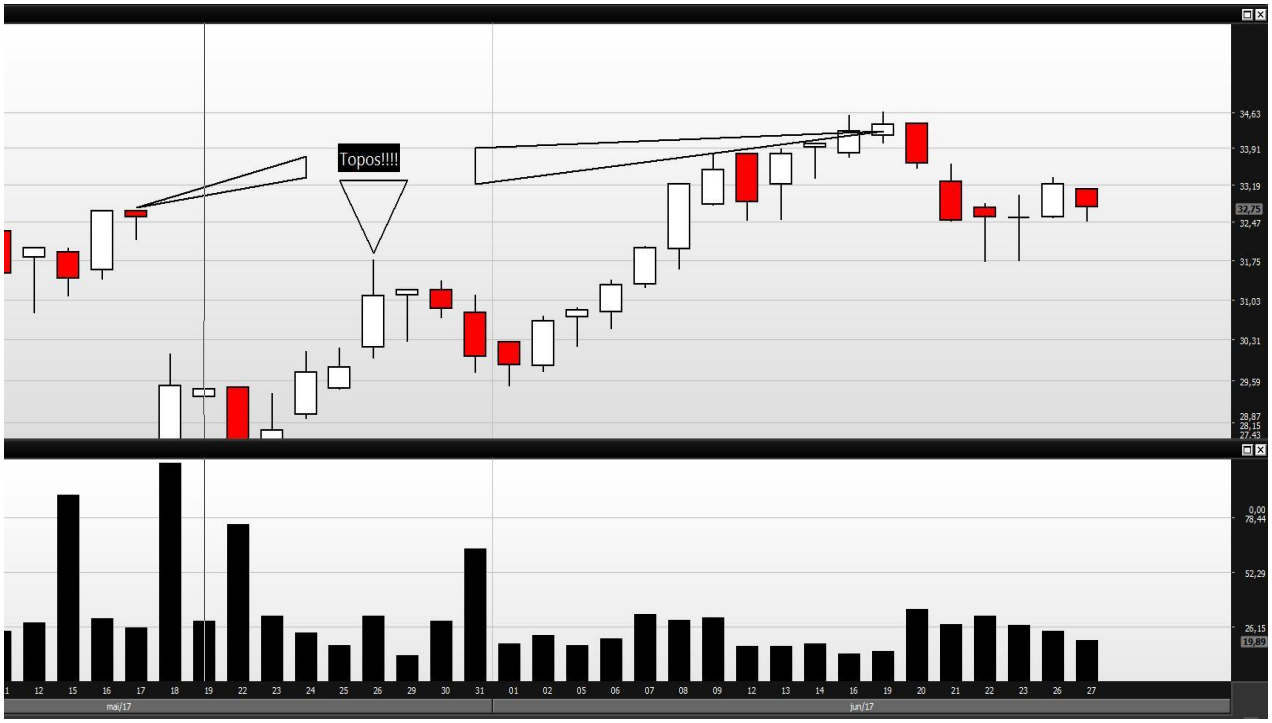
O 1-2-3 é um sistema que define fundo e topo.

Um fundo é marcado quando temos um candle que tem sua mínima antecedida por um candle com mínima acima e seguido por um candle que tem mínima acima.

Esse candle forma o fundo.



Um topo por outro lado é um candle que tem sua máxima antecedida por um candle que tem sua máxima abaixo dela e o candle seguinte tem máxima mais baixa também.



Veja os exemplos de topos neste gráfico.

Pois bem, agora siga meu pensamento:

Queremos comprar fundos em uma tendência de alta.

O que significa que ao localizar um 1-2-3 de fundo em um ativo que esteja com seus preços entre a banda central e a banda superior, temos o sinal de tomada da posição na ruptura da máxima do candle que formou o fundo.



Podemos usar esses sinais para vendas e podemos usar para compras.



Veja no gráfico de 15 minutos. O ponto fica muito claro.

Podemos definir o alvo como 161 % da amplitude do candle comprado ou fechar a posição somente quando o ativo atingir a banda superior da Bollinger.

Os dez minutos para a glória:

Definição desse sistema – Volatilidade. NÃO nos importamos com a tendência do ativo.

Esse sistema é bem interessante.

Um modelo ousado, que é utilizado por hedge funds.

SINAL:

1- Compramos o ativo assim que este fechar um tick abaixo da banda inferior da Bollinger.
2- Projetamos 130% da amplitude do candle que gerou a entrada como estope.
3- Fechamos a posição quando o candle fechar acima da média móvel (banda central).

Esse modelo pode ser usado em vários time-frames.

Lembre-se:

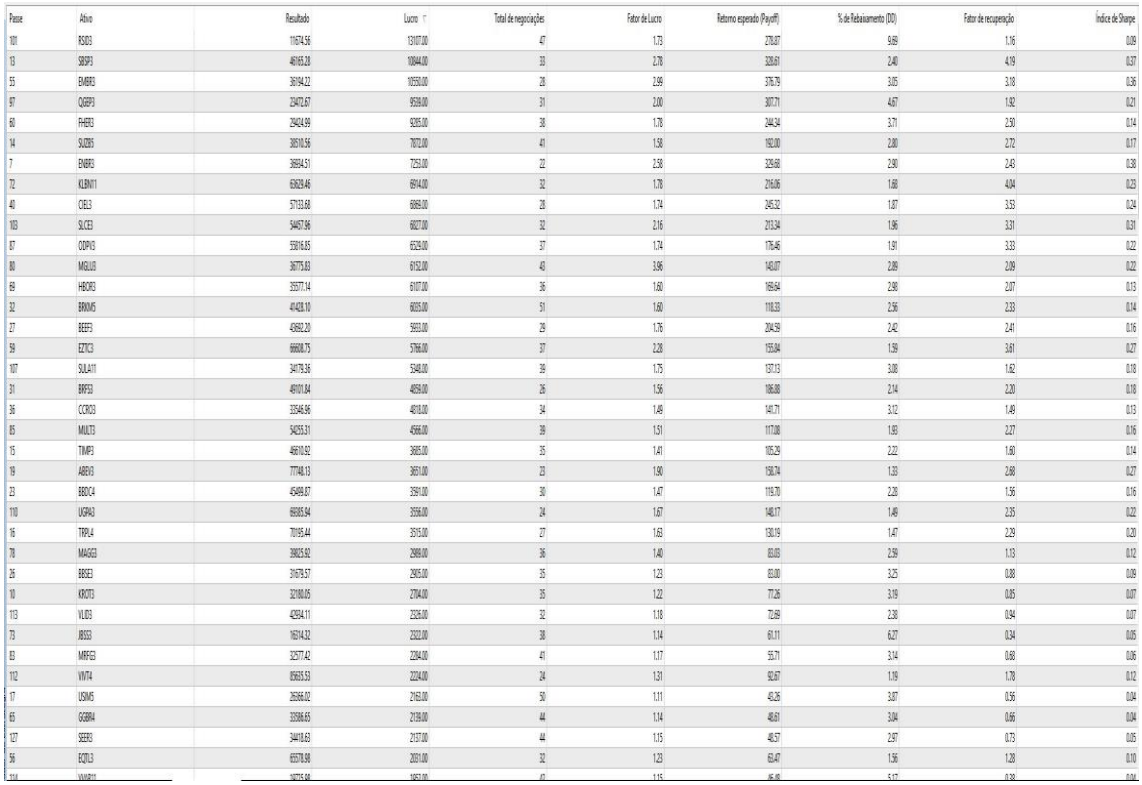
Time frame de volatilidade = 10, 15 minutos ou diário.

Time frame de tendência = 60 minutos e semanal.

Esse modelo é de volatilidade ou de retorno a média.

Uso muito ele em robôs. Mais interessante de ser usado em ETFs, índices e empresas com alta liquidez.

Observe que esse modelo no diário em dois anos produziu resultados bem atraentes em diversos ativos, em cima de uma conta com R$20.000,00.



Passe	Ativo	Resultado	Lucro	Total de negociações	Fator de Lucro	Retorno esperado (Payoff)	% de Rebaixamento (DD)	Fator de recuperação	Índice de Sharpe
101	RSID3	11674.56	13107.00	47	1.73	278.87	9.69	1.16	0.09
13	SBSP3	48165.28	10844.00	33	2.78	328.61	2.40	4.19	0.37
55	EMBR3	36194.22	10250.00	28	2.99	376.79	3.05	3.18	0.36
97	QGEP3	23472.67	9538.00	31	2.00	307.71	4.07	1.92	0.21
60	FHER3	29424.99	9265.00	38	1.78	244.34	3.71	2.50	0.14
14	SUZB3	38510.56	7072.00	41	1.58	192.00	2.80	2.72	0.17
7	ENBR3	36954.51	7253.00	22	2.58	329.66	2.90	2.43	0.28
72	KLBN11	63629.46	6914.00	32	1.78	216.06	1.68	4.04	0.23
40	CIEL3	57133.68	6686.00	28	1.74	245.32	1.87	3.53	0.24
103	SLCE3	54457.94	6827.00	32	2.16	213.34	1.96	3.31	0.21
87	ODPV3	55016.85	6526.00	37	1.74	176.45	1.91	3.33	0.22
80	MGLU3	36775.83	6152.00	43	3.96	143.07	2.89	2.09	0.22
69	HBOR3	35577.14	6107.00	36	1.60	169.64	2.98	2.07	0.13
32	BRKM5	41428.10	6005.00	51	1.60	118.33	2.56	2.33	0.14
27	BEEF3	43692.20	5933.00	29	1.76	204.59	2.42	2.41	0.16
59	EZTC3	66660.75	5766.00	37	2.28	155.84	1.59	3.61	0.27
107	SULA11	34178.36	5348.00	39	1.75	137.13	3.08	1.82	0.18
31	BRFS3	49101.64	4859.00	26	1.56	186.88	2.14	2.20	0.18
36	CCRO3	33546.96	4818.00	34	1.49	141.71	3.12	1.49	0.13
85	MULT3	54255.31	4566.00	39	1.51	117.08	1.93	2.27	0.16
15	TIMP3	49510.92	3685.00	35	1.41	105.29	2.22	1.60	0.14
19	ABEV3	77748.13	3651.00	23	1.90	158.74	1.33	2.88	0.27
23	BBDC4	45498.87	3591.00	30	1.47	119.70	2.28	1.56	0.16
110	USPA3	69305.94	3556.00	24	1.67	148.17	1.49	2.35	0.22
16	TRPL4	70195.44	3515.00	27	1.63	130.19	1.47	2.29	0.20
78	MAGG3	39825.92	2988.00	36	1.40	83.03	2.59	1.13	0.12
26	BBSE3	31679.57	2905.00	35	1.23	83.00	3.25	0.88	0.09
10	KROT3	32100.05	2704.00	35	1.22	77.26	3.19	0.85	0.07
113	VLID3	42954.11	2326.00	32	1.18	72.69	2.38	0.94	0.07
73	JBSS3	16314.32	2322.00	38	1.14	61.11	6.27	0.34	0.05
83	MRFG3	32577.42	2284.00	41	1.17	55.71	3.14	0.69	0.06
112	VIVT4	85635.53	2224.00	24	1.31	92.67	1.19	1.78	0.12
17	USIM5	26366.02	2162.00	50	1.11	43.26	3.07	0.56	0.04
65	GGBR4	33086.65	2139.00	44	1.14	48.61	3.04	0.66	0.04
107	SEER3	34418.63	2137.00	44	1.15	48.57	2.97	0.73	0.05
56	ECTL3	65378.98	2031.00	32	1.23	63.47	1.56	1.28	0.10
114	WHRL1	10775.68	1957.00	43	1.15	45.46	5.17	0.39	0.04

O número baixo de sinais causa uma menor rentabilidade. Se o ativo ciclase entre vários ativos, teríamos um resultado bem melhor.

Fechou Fora fechou dentro

Definição desse sistema: Volatilidade. Não nos importamos com a tendência deste ativo.

Um modelo mais conservador do que comprar o fechamento abaixo da banda inferior da Bollinger seria:

1- Esperamos fechar abaixo da Bollinger, com uma distância maior que 1% do fechamento para a banda.
2- Esperamos candle seguinte fechar acima da banda inferior.

3- Compramos a ruptura do segundo candle, se esta ocorrer no candle seguinte. Estope na mínima do conjunto.
4- Realiza parcial no risco para cima e o resto acima da banda central.

Invertemos o sinal para vendas

O modelo pode ser empregado em qualquer time frame.



Bandas e Divergências:

Definição desse sistema: Reversão de tendência. Trabalhamos a reversão da direção prévia do mercado. Volatilidade.

O modelo associa as bandas de Bollinger e o MACD histograma.

Sinal:

1- Marcamos o nível do MACD histograma quando os preços batem pela primeira vez na banda inferior.
2- Esperamos que os preços subam e depois batam de novo na banda inferior, marcamos o nível do MACD histograma. Esperamos formar o 1-2-3.
3- Se houver divergência altista, tomamos a posição no rompimento de 3.
4- Estope na mínima do conjunto e alvo na banda superior.



O modelo pode ser claramente operado nas duas pontas, basta que invertamos a lógica.



Criando um patrimônio com as Bandas de Bollinger:

Definição desse sistema: Volatilidade Não nos importamos com a tendência do ativo, mas sim com sua qualidade.

Usaremos como ferramentas:

Bandas de Bollinger – sinal de venda será dado quando preços fechando acima da banda superior.

Ifr2 acima de 90.

Buscamos ganho de 3%, colocamos estope 5% acima.

O truque basicamente é calcular quanto recebemos pela venda inicial, projetando usar esse valor para recomprar MAIS ações do que inicialmente vendemos.



Então veja, nesse exemplo: Vendemos 500 Bova11 a R$41,96. Isso traz um financeiro de R$20980,00. Nosso alvo, 3% abaixo do ponto de venda, está em R$ 40,70.

Caso o ativo bata em nosso alvo e recompremos todo o financeiro em bova11, poderíamos comprar 515 Bova11. Neste caso, compramos 510 bova11 e ficamos com 10 bova11 em carteira para o resto da vida.

Com esse modelo, vamos criando uma carteira a partir de um capital designado para esse modelo.

Só podemos usar isso em ativos que queremos ter em carteira:

Suzb5, embr3, abev3, bvmf3, Cesp, taee11, bova11, brap4, grnd3 e ccro3 são ótimos exemplos de ativos que operam bem por esse modelo.

O modelo tem um nível de acerto perto de 75% dos trades realizados, infelizmente são poucos sinais por ano. Outro aspecto importante: Se o fechamento ocorre APÓS um estreitamento das bandas de Bollinger NÃO REALIZE a venda alugada.

Posto que esse estreitamento produziu uma preparação para fortes puxadas.

Vou colocar aqui uma operação realizada no dia 28/06/2017. Estou escrevendo a apostilha e acabei de iniciar o trade. Ainda não sei seu resultado.



Conclusão da Segunda parte:

Vimos que as bandas de Bollinger podem nos ajudar a localizar os ativos mais poderosos em suas tendências.

Bem como nos dar um sinal de qual ponta devemos operar.

Além disso, a banda de Bollinger pode nos oferecer modelos de volatilidade sim, usando basicamente os modelos descritos neste capítulo.

Senhores, precisamos como traders nos definir.

No sentido de estruturar quais sistemas e quais modelos iremos usar nas nossas vidas.

Vimos alguns modelos seguidores de tendência e outros de volatilidade.

A seguir iremos ver como operar mudanças de tendência.

Terceira parte:

Mudança dos ventos

Já aprendemos como localizar ativos em forte tendência. Porém apesar de serem muito raras e de ser extremamente difícil uma mudança de tendência, sabemos que elas, de tempos em tempos, ocorrem.

Uma tendência, antes de mudar de direção, costuma avisar seu enfraquecimento.

Cabe ao Trader profissional observar os sinais e ficar prevenido para a mudança.

Primeiro precisamos lembrar que as tendências tecnicamente só mudam após um pivô contrário se estabelecer e ser acionado.

Desta forma, se um ativo está em tendência de baixa, com uma sequência de topos e fundos em queda, a única forma que mude para uma tendência de lado ou uma de alta seria com a mudança na disposição dos fundos e topos.

Uma tendência de alta pode iniciar sua mudança sempre pelo aparecimento de um TOPO abaixo ou NO mesmo nível que o topo prévio.

Quando isto ocorrer, podemos observar a perda do último fundo e, ali, termos o pivô de baixa, ou o recuo até o ultimo fundo e, por conseguinte, a mudança para uma tendência de lado.

MARQUE:

" Toda vez que um fundo se formar ACIMA do fundo prévio, podemos estar observando um pivô de alta. "

Sendo que este é o primeiro e mais precoce sinal de possível reversão da tendência.

Assim sendo, se estamos operando uma tendência de alta e localizamos um topo se formando, abaixo do último topo, somo OBRIGADOS a subir o estope da posição comprada para um tick abaixo da mínima do último fundo.



Este gráfico mostra uma tendência de alta, que já demonstra alguns sinais de cansaço.

Porém, mesmo um Trader que tenha tomado a posição na ruptura da máxima do penúltimo candle, iria seguir o trade.



Veja que o ultimo dia, constrói um topo, agora abaixo do topo anterior. SOMOS OBRIGADOS a puxar nosso stop para um tick abaixo do último fundo.



Para que possamos então perceber rapidamente a mudança das tendências o truque mais imediato que posso lhes passar é: acostume-se a colocar sempre uma seta em cima de cada novo topo e uma abaixo de cada fundo, especialmente do último e penúltimo topo ou fundo.

Dois tipos de pivô de alta:

1- Pivô precoce – O topo do pivô de alta está abaixo do penúltimo topo.
2- Pivô de alta tardio – o topo do pivô de alta está acima do penúltimo topo.

O pivô tardio é difícil de ser operado, os estopes são caros e a alta mais forte já ocorreu e não estávamos dentro do barco.

Tendências fortes e sólidas guardam três características:

a- O recuo NÃO perfura o ultimo topo rompido.
b- O recuo é MENOR que a última perna de alta.
c- O recuo não rompe a three line bar.



Note que o recuo 1,2 e 3 são recuos dentro de uma tendência de alta solida e estável.

O recuo 4 demonstra que a tendência perdeu força, o próximo avanço será mais fraco e hesitante.

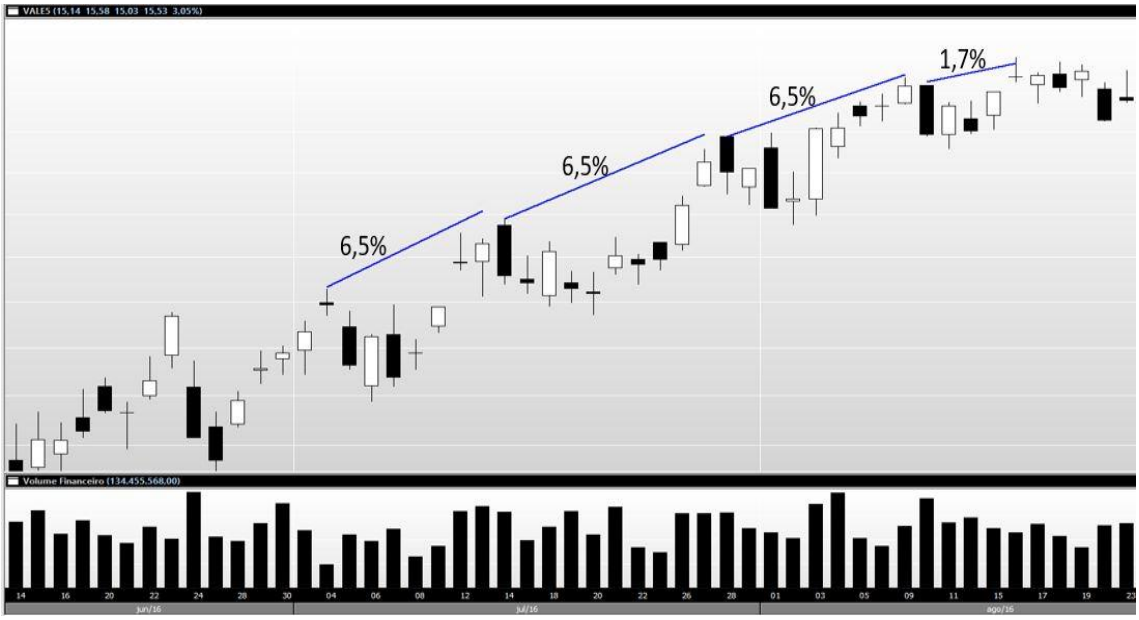


Marque este outro sinal:

Uma tendência de alta sólida, após o rompimento do topo prévio temos um deslocamento forte e que se afasta muito dele.

Usualmente a mesma distância que se afastou nos rompimentos anteriores.

Quando após o rompimento, nos afastarmos menos do que percentualmente nos afastamos nas ultimas vezes, teremos observado um enfraquecimento da tendência.



Three line Bar

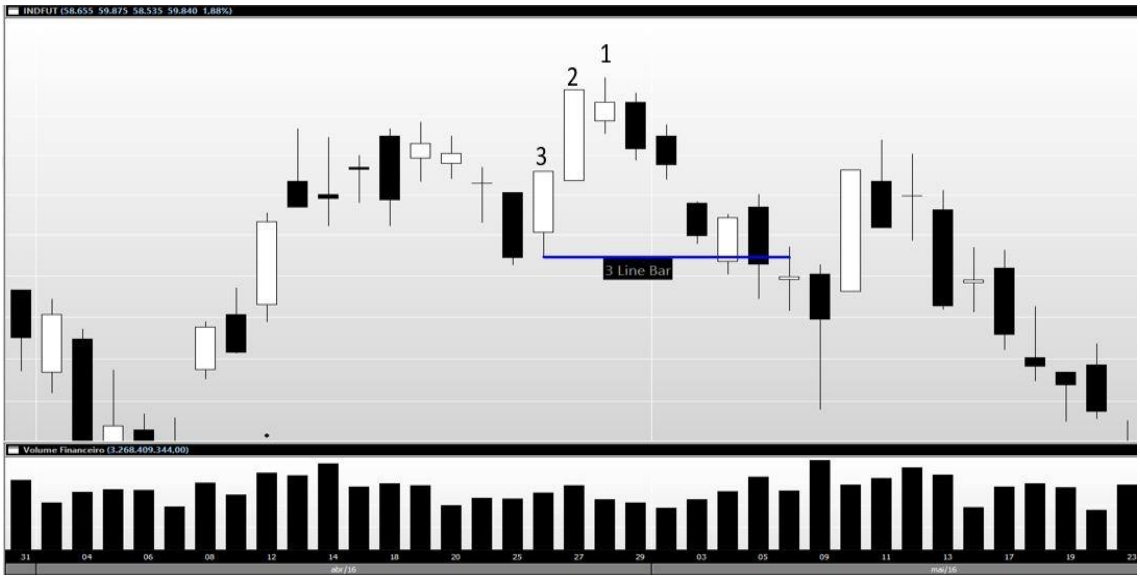
Joseph Stowel sempre ficou muito incomodado com os pivôs de alta tardios. Aqueles que subiam reto sem darem pontos tranquilos de entrada.

Dessa forma ele cansou de esperar por pivôs de baixa ou de alta para considerar uma mudança de tendência.

Construiu a ideia de uma three line bar.

Mudança de uma tendência de alta para baixa:

1- Procuramos o candle que tem a maior máxima. Marcamos sua mínima como candle 1.
2- Procuramos o candle que tem a mínima imediatamente abaixo deste, será a mínima 2.
3- A partir do candle com mínima 2, procuramos o candle que tem a mínima imediatamente abaixo desta. Ali será a three line bar.
4- Se fecharmos abaixo desta linha, mudamos para tendência de baixa.
5- A linha é recalculada toda vez que houver o renovamento de máximas.



Para reverter uma tendência de baixa:

Procuramos candle que tem a menor mínima, este será o candle 1. Marcamos usa máxima

Comparamos qual candle tem sua máxima imediatamente acima. Este é o candle 2. Marcamos usa máxima.

Procuramos o candle com máxima imediatamente acima, este é o candle 3 e sua máxima a three line bar.

Cada renovação de mínima redesenhamos a three line barra.



Um pivô de alta atinge sua expansão de Fibonacci básica em 66% das vezes em média para a maioria dos ativos.

Isso poderia por si só ser um modelo operacional.

TRUQUE DE ENTRADA:

Para compra:

Toda perna de alta DENTRO de uma tendência de baixa, iremos marcar a zona entre 0 e o Fibo de 38%. Essa zona será chamada de buy-zone.



Iremos esperar que os preços ao retomar a queda, recuem e entrem na buy zone.

Localizaremos a máxima do candle que entrou na buy zone como nosso ponto inicial de compra.

Vamos descendo nosso ponto de entrada pela máxima de cada novo candle, até que tenhamos comprado OU os preços tenham perdido o último fundo, neste momento, tiramos a ordem de compra, já que a tendência de baixa irá prosseguir. Se tivermos comprado o ativo, nosso stop fica no ultimo fundo observado.

O alvo será 161% do risco assumido para cima.

Uma bela estratégia, que tem um stop curto e um alvo longo. Procura ganhar em cima da reversão da tendência vigente.



Observe o ativo recuando e atingindo a Buy zone. Note que a máxima do candle foi superada e isso traz a entrada. O alvo é 161 do risco para cima.



Alvo atingido 3 dias depois da entrada.

Esse modelo foi descrito por John Crane em seu excelente livro “Unlocking Wealth”.

Logicamente pode ser invertido para nos oferecer os sinais de venda.

Agora podemos ser ainda mais elegantes.

Podemos olhar um time frame maior, buscando por zonas de suporte.

Ao localizar esse suporte no time frame maior, entramos no time frame menor, que estará em tendência de baixa e iremos procurar pelo truque de entrada na buy zone.



Note temos a CVCB3 atingindo a zona de suporte do diário no gráfico esquerdo, topo anterior rompido e média móvel.

Entramos nos 60 minutos, desenhamos o Fibo da última perna de alta e marcamos a buy zone.

Tomamos a posição na ruptura da máxima da hora que entrou na buy zone. Estope na mínima e alvo 161 % do risco para cima.



Capturamos 2,09% em duas horas com um risco bem diminuto.

Conclusão da parte 3:

As tendências podem sofrer enfraquecimentos. Estes podem ser observados e podemos capturar bons ganhos em suas mudanças.

As divergências podem ajudar na identificação dessas mudanças e, por isso mesmo, vamos estuda-las a seguir.

Quarta Parte:

Divergências:
As divergências aparecem quando existe uma diferença de movimento entre os preços e os indicadores que estamos acompanhando.

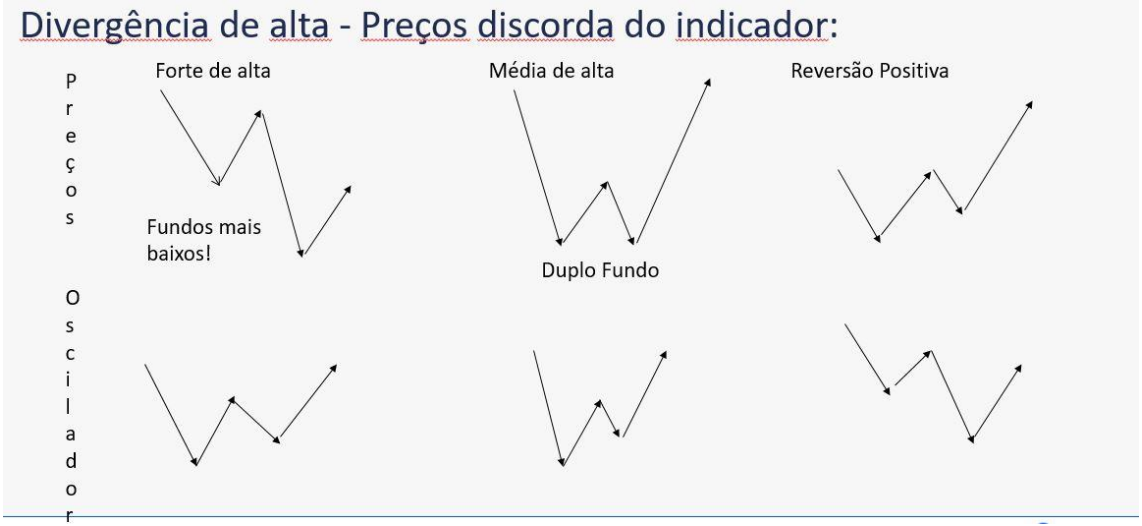
Se localizarmos uma divergência e essa for acionada, produzindo a reversão da tendência previa no diário, podemos esperar que seu efeito perdure por algo em torno de 2 a 3 meses.

Assim sendo:

Uma divergência de alta ocorre quando:

1- Preços com fundos mais baixos e indicador com fundos mais altos.
2- Preços com fundos no mesmo nível e indicador com fundos mais altos.
3- Preços com fundos mais ALTOS e indicador com fundos mais baixos.

A última situação recebe o nome de reversão positiva e é muito potente em papeis que estejam em tendência mais longa de alta.



Mas como operar a divergência uma vez que a tenhamos localizado?

Primeiro observe que divergências precisam ser entre fundos IMEDIATAMENTE juntos.

O último fundo com o penúltimo fundo.

Segundo observe que o sinal de operar a divergência de alta seria na ruptura da linha de baixa contra a qual a divergência opera. Mas isso é um tanto quanto subjetivo. Por isso, o sinal mais efetivo é: localizada uma divergência de alta, esperamos um candle que feche acima da média de 20 períodos. Ali teremos nosso ponto de início da operação de compra.

Reversão Positiva:

Definição: Volatilidade

Iremos esperar um fundo acima do prévio nos preços. 1-2-3 acima do último fundo.

Iremos olhar o IFR, se este estiver abaixo do fundo prévio temos a reversão positiva.

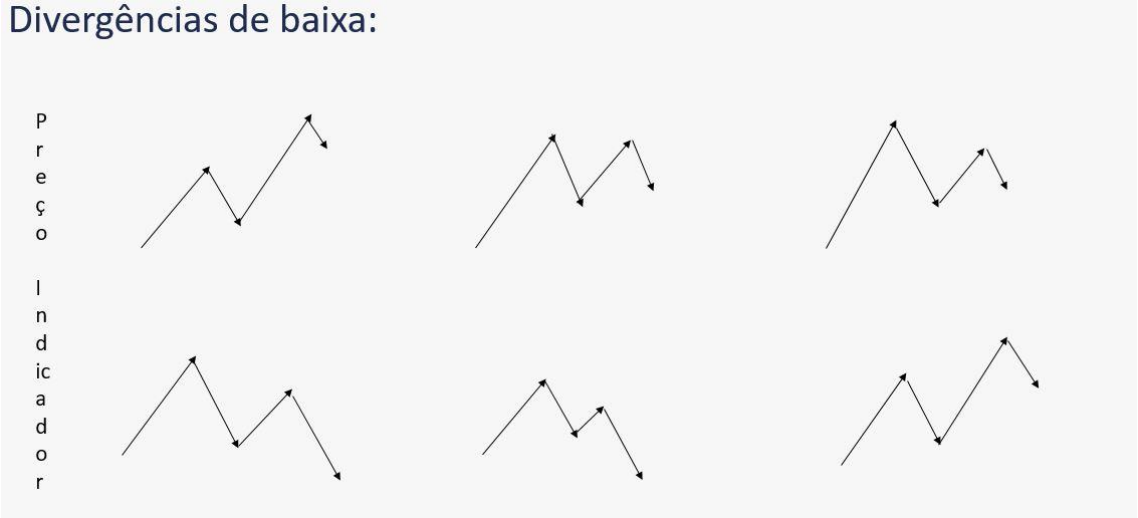
Nosso ponto de entrada será a superação do ponto 3 do segundo fundo.

Medimos a distância do preço de fechamento do segundo fundo para o preço de fechamento do primeiro fundo. Essa distância será o quanto nosso mercado ira ir ACIMA do último topo.



Divergências de baixa seguem com a lógica inversa:

1- Topos nos preços mais altos e topos nos indicadores mais baixos.
2- Topos nos preços no mesmo nível e topos no indicador mais baixo.
3- Topos nos preços mais baixos e topos no indicador mais altos.



Desses coloco aqui um exemplo de Reversão Negativa:



Conclusão da parte 4:

Ao aparecer uma divergência e ela ser acionada podemos ter iniciado uma belíssima campanha.

Entenda um trade é como uma pequena batalha. Uma sequência de trades encaixados em um mesmo ativo constroem uma campanha de guerra.

Existem momentos do ano que são perfeitos para uma campanha. Como na guerra, uma campanha no inverno é ruim. O inverno no mercado seria o momento não direcional, mercado de lado, fino e estreito.

Saber identificar os momentos de início de ótimas campanhas nos ajuda de sobremaneira.

Assim, após uma divergência de alta precisamos comprar todos os pontos que o mercado nos oferecer a seguir. E por isso mesmo, irei agora falar sobre os melhores pontos de entrada na compra e na venda que você pode utilizar, com risco baixo e alvo longo.

Capitulo 5 -

Sistemas de entrada de baixo risco:

Uma entrada de baixo risco é aquela que possui um estope curto e um alvo longo. Paralelo a isso, possui ainda um nível de acerto maior que 60%.

Para que localizemos esse tipo de operação, precisamos observar uma serie de pontos:

1- Localização do gráfico (perto do suporte ou da resistência).
2- Direção da tendência;
3- Potência da tendência.

Dessa forma, o primeiro conceito que preciso abordar:

OPERE O SINAL SEMPRE A FAVOR DO TIME FRAME IMEDIATAMENTE SUPERIOR AO QUE ESTÁ OPERANDO.

Se opera no diário, o time frame superior é o semanal.

Se opera nos 60 minutos o time frame superior é o diário.

Usamos o time frame maior para nos dar a direção da operação e o time frame tático para procurar os sinais.

Uma ferramenta muito interessante para localizar bem a direção de nossos trades é o estocástico lento, descrito por Robert Miner.

Ele usa 13 períodos com uma média de 8.

Essa ferramenta irá nos oferecer os estados sobre comprados e sobre vendidos usuais bem como a direção que precisamos obedecer nossos trades.

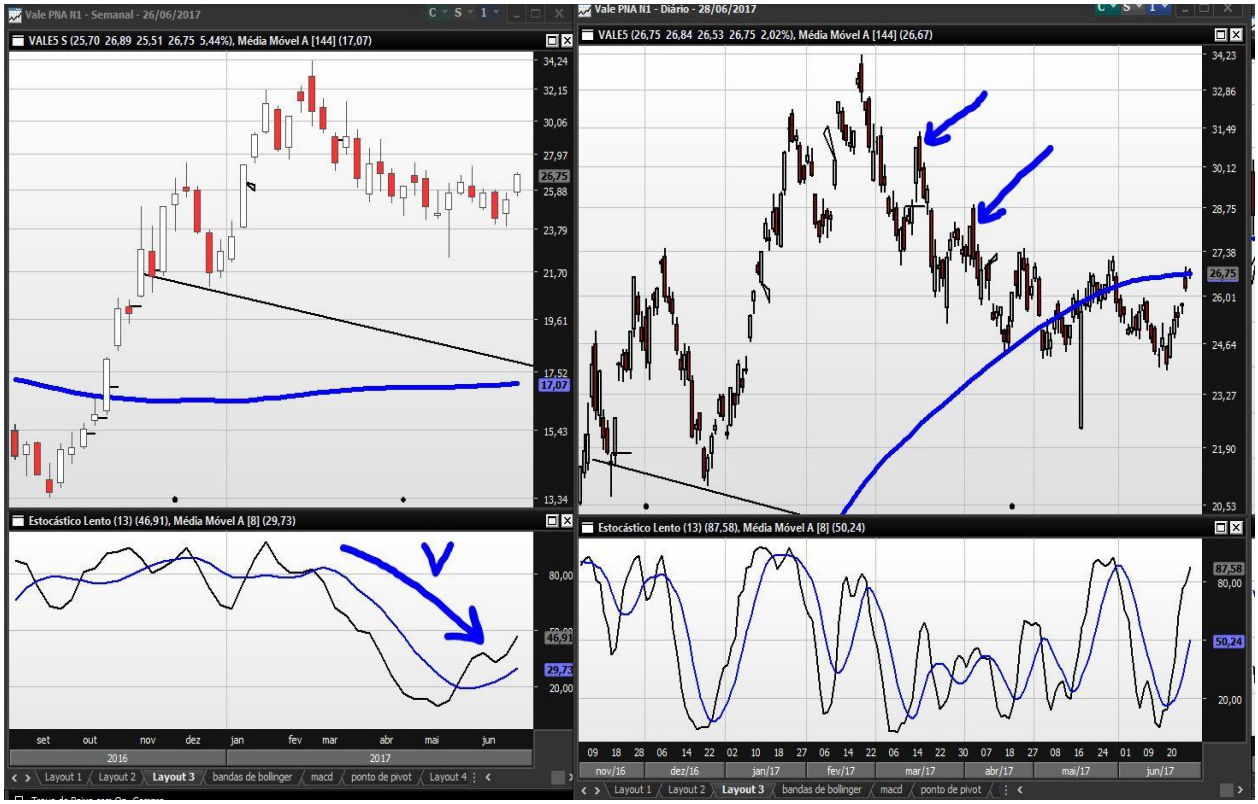
Quando o estocástico e a média estiverem descendo paralelas, procuramos por sinais de venda no time frame menor.

Quando tivermos ambos subindo, procuramos sinais de compra no time frame menor.

Veja este exemplo:

Temos o semanal com o indicador orientando procurar sinais de venda no time frame menor.

Assim sendo:



Sinal 1

Estocástico define:

Definição: Reversão de tendência

Para compra:

Procuramos um evento em que o estocástico esteja sobre vendido e abaixo de 20. Vamos esperar que o estocástico siga acima da média, depois recue e vá abaixo da média e logo a seguir torne a subir.

Criando um " W".

Essa segunda penetração no indicador oferece uma ótima entrada no ativo, com estope curto e alvo bem longo. O alvo seria deixar subir entrar acima da zona de sobre compra e cortar abaixo da média.



Note a situação sobre vendida da PETR no diário.

Entramos nos 60 minutos e vemos o estocástico formando o " W". Ponto de entrada na ruptura da máxima do candle que levou o estocástico para acima da média pela segunda vez.

Sinal 2 Turtle Soup:

Definição: Volatilidade.

Aqui vamos operar CONTRA o modelo Turtle Soup clássico.

O modelo deles preconiza tomada de posição na superação da máxima de uma congestão de "n" candles. Este modelo tem um nível de acerto baixo, mas um elevado pay-off. Ou seja, eles erram muito, mas quando acertam o movimento é amplo.

Bom, vamos operar CONTRA ele.

De que forma?

Marcamos a máxima dos últimos 20 dias.

Vamos esperar uma abertura acima da máxima destes últimos 20 dias. E iremos esperar que feche abaixo disso. A perda dessa mínima oferece o nosso sinal de venda.



Logicamente podemos usar o sinal inverso para uma compra.

Novamente, um stop curto e um alvo longo.

O modelo tem um bom nível de acerto, alvos longos, estopes curtos, seu defeito é o baixo número de sinais.

Podemos deixar ele ainda melhor apenas usando os sinais que forem a favor do estocástico do time frame maior.

Sinal 3 Disfarce para compra:

Definição: Seguidor de tendência.

1- Dia anterior fechamento menor que abertura (um dia de queda);
2- Dia atual com fechamento abaixo do fechamento prévio;
3- Dia atual em alta;
4- Dia atual deve ter a menor mínima dos dois últimos dias.

Essas situações juntas demonstram um mercado que está fingindo que quer continuar caindo, quando de fato os compradores já começaram a assumir posições.

Entrada no fechamento deste dia ou no Ater Market.



Veja o candle assinalado no diário na Natu3. Ele responde todas as situações necessárias para encaixar em um padrão de compra dissimulada.

O modelo tem um ótimo nível de acerto, um estope bem curto e um alvo longo. Alvo aqui é 161 do risco para cima.

Se fizermos isso em uma tendência de alta, com nosso estocástico lento do time frame maior indicando compras, podemos usar alvos ainda mais longos como 2 ou 2,5 vezes o risco.

Sinal 4 Disfarce para venda:

Bom, invertemos a lógica e procuramos o seguinte:

1- Dia anterior em alta.
2- Dia atual com fechamento acima do fechamento do dia prévio.
3- Dia atual em baixa.
4- Dia atual tem maior máxima dos dois últimos dias.

Aqui também o mercado tenta esconder que deseja cair. Por isso, procedemos nossa venda no fechamento ou no After deste dia.

Quanto mais sobre comprado o ativo, tanto melhor.



Nos estudos que fiz o estocástico não ajudou na melhor definição dos disfarces, mas o ifr2 alto ou baixo sim.

Sinal 5 – Gap de Abertura de compra:

Definição: Trade a favor da tendência. Day trade estendido

1- Procuramos um papel que tenha aberto abaixo da mínima do dia anterior.
2- Quando isto ocorrer, colocamos uma compra 1 tick acima da mínima do dia prévio.
3- Quando essa região for tomada, assumimos a posição e estope pega 0,61 do candle prévio e joga o estope para abaixo a partir da abertura do novo candle.
4- Se fechar como um piercing pattern, podemos levar para o dia seguinte.



Localize os quatro gaps de compra que foram produzidos.

Logicamente tentar favorecer o trade junto com a tendência.

Sinal 6 – Gap de abertura de venda:

Invertemos a lógica e com isso temos o sinal de venda.

1- Procuramos uma abertura que tenha sido acima da máxima do dia prévio.
2- Colocamos uma venda um tick abaixo dessa máxima.
3- Estope projetamos 0,61 da amplitude do candle prévio para acima a partir da máxima deste dia.
4- Fecha trade no final do dia.



Duas boas vendas, simples e objetivas.

Sinal 7 Armadilha de compra:

Definição: Contra tendência. Volatilidade.

Vamos aqui pegar os vendidos no contrapé e ganhar dinheiro em cima dos stops que estarão sendo acionados.

Vamos procurar um ativo que venha abaixo da média de 20.

Subir até esta média, batendo nela. Esperamos um candle vermelho. A máxima desse candle será nosso ponto de entrada, posto que se for rompida, os vendidos irão estopar seus trades. Pode ocorrer a entrada até 3 dias após o candle vermelho.



Alvo 161% do risco para cima.

Sinal 8- Armadilha de venda:

Definição: Contra tendência, captura reversão. Volatilidade

Aqui vamos nos aproveitar do stop dos comprados.

Assim sendo, vendo preços acima da média de 20, recuarem até esta média, iremos esperar um candle branco. A mínima desse candle NÃO pode mais ser perdida, se o for, temos nossa venda perfeita. Com nosso estope acima do candle branco. Alvo 161 do risco para baixo.



Sinal 9 – Pin Bars ou Candles pavio:

Uma pin Bar, prenuncia um candle enorme a seguir.

Quando visualizamos uma barra pavio, saiba que o próximo candle tem enorme chance de ser muito grande.

A barra pavio tem seu corpo medindo menos de 25% da amplitude do candle total.

Duas formas para operar. A primeira esperar a ruptura da máxima ou da mínima desta, para toma a posição.

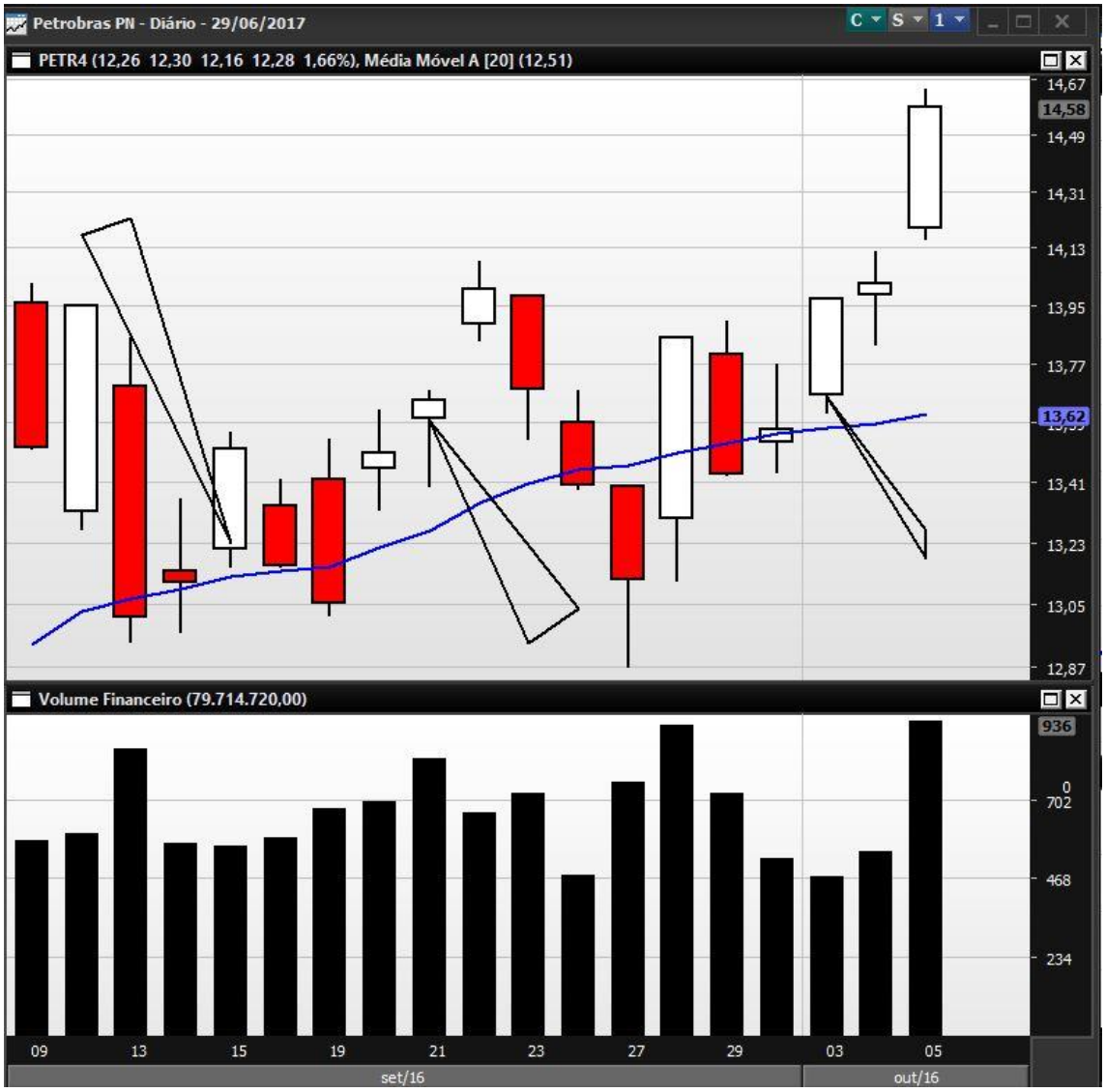
A forma mais agressiva e interessante é:

Se o candle pavio ocorre numa tendência de alta, marcamos seu fechamento.

Quando o candle seguinte abrir acima desse fechamento, assumimos uma compra, com estope logo na mínima. Alvo 161 ou 200 % da amplitude dessa barra pavio.

Se for uma barra no semanal, eu fecho o trade na sexta-feira da semana seguinte.

Para que possa ser operado, a abertura do candle seguinte PRECISA estar contida pela máxima e mínima do candle pavio.



Três pontos de entrada bem posicionados.

Sinal 10 – Pontos de swing ou 1-2-3:

Definição: Seguidor de tendência.

O ideal não é comprar um fundo dentro de uma tendência de alta?

O modelo 1-2-3 não mostra para nós onde o mercado está formando um fundo?

Então, iremos procurar ativos em tendência de alta. Critérios Carolina, força relativa ou preços entre banda central e banda superior.

Procuramos um 1-2-3 de fundo e compramos a superação da máxima do candle 3.

Estope na mínima do conjunto e alvo 161 do risco.



Todos esses sinais no diário são 1-2-3 rompidos para cima dentro de uma tendência de alta.

Conclusão da Quinta parte:

Vimos pontos muito simples de localizar trades. Vimos que são simples, porém são muitos.

Se ficarmos olhando 30 papeis ao mesmo tempo, não iremos conseguir capturar todos os sinais que aprendemos.

Portanto: fica a dica " especialize-se".

Opere um único papel, todos esses sinais ensinados

OU

Opere um ÚNICO sinal desses em vários papeis.

NÃO tente operar todos esses sinais em todos os papeis.

Montando nossa Estratégia