

Hedge do Softy e SHM Trading – 01/01/2023

Breve Descrição: o objetivo deste material é complementar as instruções do descritivo do SHS e do SHV. A estratégia de Hedge foi criada para auxiliar os clientes no gerenciamento do open balance eventualmente enfrentado em operações das estratégias do SHS e/ou do SHV. Esta estratégia não tem por finalidade operações independentes e ela faz operações de forma dependente, ou seja, ela fará entradas apoiada no SHS e no SHV.

Alguns pontos importantes:

- **Gestão manual:** A estratégia detém uma programação interna que permitirá que ela faça o encerramento automático (auto proteção) em alguns cenários. Ocorre, entretanto, que em determinados cenários poderá ocorrer do fechamento não ser acionado por condições e movimentos no ativo operado. Nesta situação, cada usuário deverá avaliar e gerir manualmente o Hedge, fechando manualmente operações.
- **Modelo operacional:** A estratégia está programada para fazer entradas contra a outra estratégia em uma proporção a ser definida pelo usuário. A Estratégia está programada para entrada inicial de aproximadamente 40% da posição detida no outro robô (SHV ou SHS) observando a configuração feita pelo usuário, conforme a seguir. Os demais 60% ficarão disponíveis para entradas adicionais e ocorrerão a medida em que o preço se desloque contra o Hedge. A estratégia usa indicadores internos para auxiliar a entrada, logo não será em todo cenário que o hedge atuará. Idealmente ele irá atuar sempre que o mercado andar contra a estratégia que está sendo protegida e poderá executar saída automática quando o contrário for verdadeiro.

Campos disponíveis para configuração do usuário:

- **Magic number do robô:** será fornecido um preset já configurado considerando os sets que temos no CSA. Caso o cliente deseje criar versões do set hedge para outras finalidades/estratégias diferentes das que temos no CSA, ele deverá atentar que o magic number do robô nunca poderá ter mais que 9 dígitos.
- **Nome do Set:** Este nome não interfere em entradas e poderá ser livremente configurado pelo cliente.
- **Lote do robô:** o lote inicial do robô Hedge está programado para ocorrer SEMPRE que o robô observado/protegido estiver com posições que somem 3x o lote inicial do Hedge. Se temos um robô com posição total equivalente a 0.03 e trabalharmos com lote inicial de 0.01 no robô hedge, nós teremos o início de operações no robô hedge. A entrada ocorrerá respeitando a configuração do R18 e dinâmica interna dos 40%.
- **Tempo Gráfico do Robô:** Toda a estratégia foi desenhada com uso do indicador técnico Average True Range (ATR). Este indicador calcula o tamanho dos candles e é usado para medir a volatilidade. Ao alterar o tempo gráfico o cliente alterará a distância das saídas de forma automática. A mudança no tempo gráfico também afetará as defesas adicionais do sistema (60%), sendo menor a distância entre as defesas quando utilizado tempo gráfico menor. A distância está configurada em 4x o valor do ATR. Alguns ativos têm ATR maior e outros menores e esta foi o melhor valor encontrado.


- **Campo R18:** neste campo o usuário deverá indicar o percentual de proteção que deseja usar. Este campo trabalha com números decimais, ou seja, 1 é igual a 100%, 0.50 igual a 50%. O Hedge ao executar a entrada inicial, acima comentada, irá observar também o percentual informado neste campo.
- **Campo R19:** neste campo o usuário deverá indicar o tipo de hedge que deseja, sendo:
0 = Hedge tanto na alta e quanto na baixa
1= Hedge só na queda do mercado (Set protegido compraria e o hedge vende)
2= Hedge só na alta do mercado (Set protegido venderia e o hedge compra)
3= Hedge desligado. Somente saída de operação aberta será permitido
- **Campo R20:** neste campo o usuário deverá indicar o número magico do robô que será protegido. Este campo não poderá ter valor Zero. Caso isso ocorra, por proteção, o hedge olhará o magic 999999999.
- **Campo R32:** neste campo o usuário deverá indicar se deseja manter defesa de 12x o lote inicial mesmo após a saída do robô protegido. Manter "0" indica manter a defesa e incluir "1" ou outro número indica que o usuário não deseja ter as defesas.

Atenção: o uso do hedge requer certa experiência em mercado e na gestão futura de possíveis operações que poderão ficar abertas. A avaliação e decisão quanto ao uso é do usuário.

Antes de Pensar em programar o hedge, é importante saber que já existem sets/robôs hedge pré configurados no driver e eles já estão com os magics numbers padrões usados na conta do CSA. Se ainda assim precisar ligar um Hedge, veja abaixo alguns detalhes:

Programando o Hedge para os sets do SHS System

Passo 1: identificar o magic que será objeto do hedge. Esta informação está no EA que roda o softy ou também na aba de negociação da caixa de ferramentas. Caso esta opção não esteja visível, basta clicar com botão direito do mouse e ir em "colunas" e marcar o "ID do EA"



| Lucro | ID do EA | Comentário |
|---------|-----------|-----------------------|
| 0.98 x | 202101019 | #CM [AUDCHF-SOFTY-JG] |
| -0.80 x | 202101013 | #VM [AUDUSD-SOFTY-JG] |
| -7.94 x | 202101020 | #CM [EURCHF-SOFTY-JG] |

Passo 3: indicar o percentual do hedge a ser usado no campo R18 (Atenção: informar DECIMAL):

| | |
|---------------------------------|--|
| Preços de Referência públicos: | |
| ab [R17] Preço de Referência 17 | R18:PERC HED R19:0=ALL 1=QUEDA 2=ALTA 3=OFF 20:magic |
| ab [R18] Preço de Referência 18 | 0.5 |
| ab [R19] Preço de Referência 19 | 0 |
| ab [R20] Preço de Referência 20 | 202101011 |

Passo 4: indicar número mágico no campo R20 (não usar zero):

| | |
|--|--|
| ■■■■■■■■■ Preços de Referência públicos: | |
| ab [R17] Preço de Referência 17 | R18:PERC HED R19:0=ALL 1=QUEDA 2=ALTA 3=OFF 20:magic |
| ab [R18] Preço de Referência 18 | 0.5 |
| ab [R19] Preço de Referência 19 | 0 |
| ab [R20] Preço de Referência 20 | 202101011 |

Informação adicional sobre nível de proteção

O Hedge está programado para iniciar a proteção sempre que a posição Total for maior que 2x o lote inicial do EA hedge.

Exemplo: Se queremos proteger o EA normal após ele ter posição acima de 0.02, vamos colocar lote inicial de 0.01 no EA de Hedge e sempre que o EA protegido estiver com posição acima de 0.02 (ou seja, tiver posição de 0.03) será iniciada a proteção. **IMPORTANTE.** A entrada do Hedge também depende de um sinal, então o EA não irá abrir operação imediatamente ao ligar.

Por padrão, o Hedge está programado para entrar com 40% de hedge no start dele. Os demais 60% ficam livres para operar caso o preço ande contra o preço do hedge e a favor do set protegido.

Então, precisamos configurar no R18 o percentual que vamos proteger. Se nós lançarmos no R18 "0.50" (sem aspas) estamos falando para o EA que a proteção será de 50%.

Diante disso, ele entrará com 40% de 50% do EA a ser protegido. Se o EA a ser protegido tem 0.20 de posição, por exemplo, o set hedge irá calcular: 50% de 0.20 (que dá 0.10) e entrará com 40% inicial deste valor, ou seja, entrará com 0.04.

Diante disso, se a ideia for ter defesa maior em momentos mais críticos, deverá ser usado um percentual maior no campo R18.

Limite Operacional

O hedge está programado para abrir entradas até atingir o limite do R18 ou, quando desligado/desvinculado, até 12 posições do lote inicial do hedge.

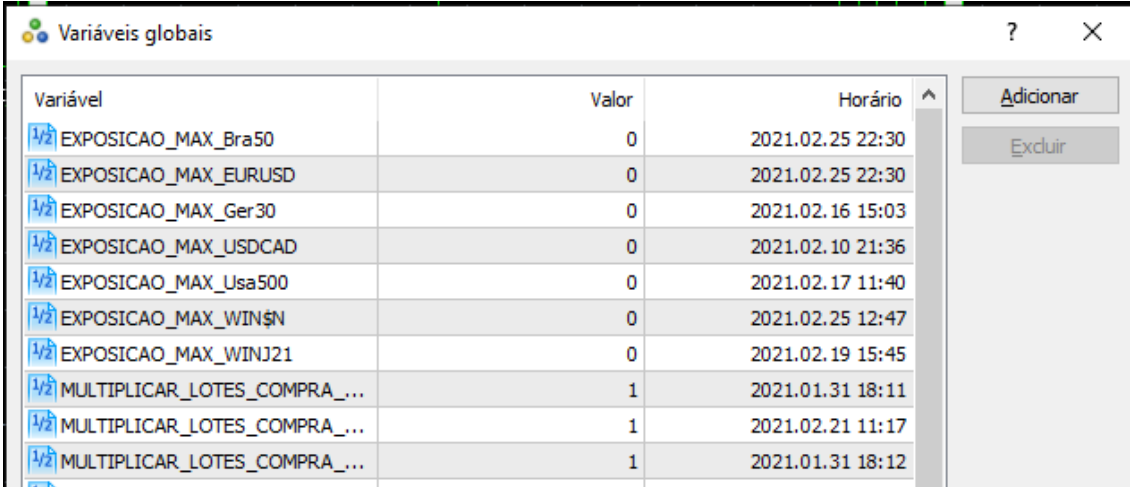
Trava Global de Segurança - IMPORTANTE

A TODOS QUE USAM HEDGE EU RECOMENDO USAR TRAVA GLOBAL POR QUESTÕES DE SEGURANÇA. O NÃO USO IMPLICA EM ASSUMIR A RESPONSABILIDADE POR QUALQUER EVENTO. ISSO SE DEVE AO FATO DE QUE OS TESTES NÃO COMPREENDEM PERÍODO LONGO. ABAIXO INFORMO COMO CONFIGURAR. No Softy podem usar limite de 0.40 nos pares e nos índices 12x o lote inicial usado nos robôs SHM.

- Configuração de Exposição máxima nos ativos:

Esta função permite que os usuários limitem o lote em determinado ativo (ex. Desejo que as operações no USDJPY não passem de 0.10). Para configurar esta trava, acesse o MT5 em que

deseja usar a utilidade, ir em Ferramentas e clicar em variáveis globais. Depois procure por “EXPOSICAO_MAX_USDJPY”. Veja a foto abaixo:



| Variável | Valor | Horário |
|------------------------------|-------|------------------|
| EXPOSICAO_MAX_Bra50 | 0 | 2021.02.25 22:30 |
| EXPOSICAO_MAX_EURUSD | 0 | 2021.02.25 22:30 |
| EXPOSICAO_MAX_Ger30 | 0 | 2021.02.16 15:03 |
| EXPOSICAO_MAX_USDCAD | 0 | 2021.02.10 21:36 |
| EXPOSICAO_MAX_Usa500 | 0 | 2021.02.17 11:40 |
| EXPOSICAO_MAX_WIN\$N | 0 | 2021.02.25 12:47 |
| EXPOSICAO_MAX_WINJ21 | 0 | 2021.02.19 15:45 |
| MULTIPlicAR_LOTES_COMPRA_... | 1 | 2021.01.31 18:11 |
| MULTIPlicAR_LOTES_COMPRA_... | 1 | 2021.02.21 11:17 |
| MULTIPlicAR_LOTES_COMPRA_... | 1 | 2021.01.31 18:12 |

Quando não localizar o ativo, clique em adicionar e insira a função usando um dos exemplos acima. Atente ao código do ativo ao final para que não tenha problemas.