



Stratium

 [Guia completo da Ferramenta Stratium](#)

Sumário

1. Visão Geral
2. Desenvolvimento de Estratégia e Aprendizado Contínuo
3. Tela de Parâmetros do Backtest
4. Onde encontrar os parâmetros no Profit Pro
5. Análise Estatística dos Resultados
6. Análise de Operações
7. Histórico de Trades

1. 📖 Visão Geral

A **Stratium** é uma ferramenta desenvolvida para traders que operam estratégias de **venda de strangle** e desejam tomar decisões com base em dados concretos. Ela permite que o usuário insira variáveis de mercado em tempo real antes de montar a operação, como **distância entre os strikes, prêmio recebido e vencimento**. Com essas informações, a Stratium realiza um **backteste completo**, simulando os resultados que seriam obtidos caso a operação fosse repetida mensalmente ao longo de **um ano ou mais**.


Essa simulação oferece uma análise histórica realista do comportamento da estratégia sob as condições informadas, permitindo ao trader avaliar riscos, retornos e possíveis ajustes antes mesmo de executar a operação no mercado.


2. 💡 Desenvolvimento de Estratégia e Aprendizado Contínuo

Com o poder da Stratium, o usuário pode **testar e refinar qualquer setup de entrada**, ajustando os parâmetros conforme o cenário de mercado. Ao longo do tempo, essa prática contínua permite que o trader desenvolva uma abordagem cada vez mais precisa e estratégica na montagem de strangles, **aumentando significativamente sua taxa de acerto**.

Mais do que apenas uma ferramenta de backtest, a Stratium funciona como um **ambiente de aprendizado** que ajuda o trader a **operar de forma inteligente** em qualquer situação de mercado. Ela transforma dados históricos em conhecimento prático, tornando-se um verdadeiro aliado na evolução e profissionalização do operador de opções.

3. 🌿 Tela de Parâmetros do Backtest

**Stratium Backtester**
Sistema de Backteste para Estratégia Strangle

 **Parâmetros do Backtest**

Ticker:

Período (anos):

Dias antes do vencimento:

Call (%)


Put (%)

Prêmio (%):

Contratos:

Saída antecipada (%):

Saída na sexta-feira: (do mês de vencimento)

 **Executar Backtest**

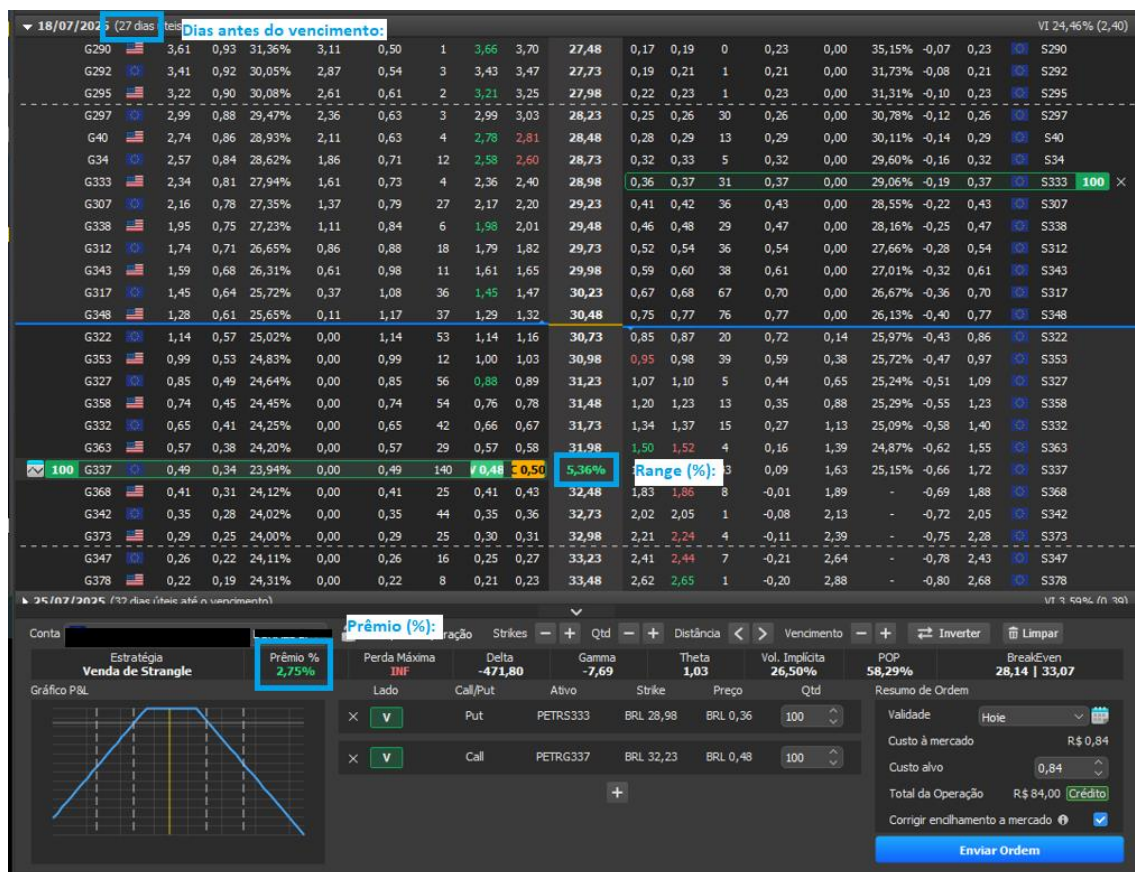
A tela principal da Stratium permite que o trader configure os detalhes da operação que deseja simular. Cada campo foi projetado para oferecer controle total sobre as condições da estratégia de **venda de strangle**. Veja abaixo a explicação de cada item:

Campos de Configuração

- **Ticker:**
Código da ação a ser utilizada no backteste. Ex: PETR4, VALE3.
- **Período (anos):**
Define o intervalo histórico no qual o backteste será executado. Ex: "1 ano" simula a estratégia repetida mensalmente por 12 meses.
- **Dias antes do vencimento:**
Quantidade de dias de antecedência em relação ao vencimento da opção. Serve para definir o momento da entrada na operação.
- **Call (%) e Put (%):**
Distância percentual entre o preço da ação e os strikes das opções de **CALL** e **PUT**, respectivamente. Esse valor define o quão fora do dinheiro será montado o strangle. Exemplo: **5% na CALL** e **7% na PUT** significa que a CALL será lançada com strike 5% acima do preço atual, e a PUT com strike 7% abaixo do preço atual.
- **Prêmio (%):**
Percentual mínimo em prêmio desejado para aceitar a operação. Esse filtro impede a simulação de operações com prêmio muito baixo.
- **Contratos:**
Quantidade de contratos simulados por operação. Ex: 1000.
- **Saída antecipada (%):**
Percentual de lucro sobre o prêmio recebido que, ao ser alcançado, encerra a operação antes do vencimento. Ex: 60 encerra a operação quando 60% do prêmio é atingido.
- **Saída na sexta-feira (do mês de vencimento):**
Define se a saída ocorrerá na **primeira sexta-feira** (ex: 10 dias antes do vencimento) ou na **terceira sexta-feira** (data de vencimento da B3).
 - **Primeira:** saída antecipada
 - **Terceira:** leva a operação até o vencimento
- **Executar Backtest:**
Botão que inicia a simulação com base nos parâmetros definidos.

4. Onde encontrar os parâmetros no Profit Pro

A imagem abaixo mostra claramente onde você pode localizar os principais dados utilizados na ferramenta **Stratium Backtester** dentro do **Profit Pro**, para que consiga montar um strangle com base em dados reais de mercado.



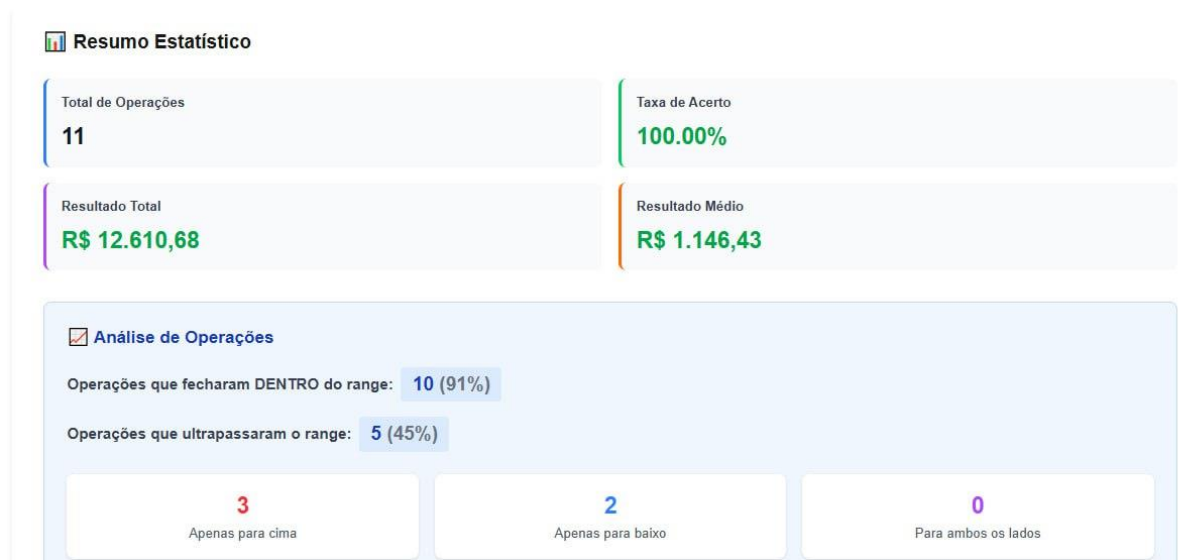
Tela de montagem da operação no Profit Pro:

Parâmetros destacados na imagem:

- Dias antes do vencimento:**
Indicado no topo da tela: 27 dias. Corresponde ao campo “**Dias antes do vencimento**” na Stratium. Esse valor indica com quantos dias de antecedência a entrada será feita em relação ao vencimento da opção.
- Range (%) – Distância dos strikes (CALL e PUT):**
Localizado nas colunas centrais da grade de opções.
Exemplo da imagem:
 - CALL G337:** Strike 32,23 → 5,34% acima do preço atual.
 - PUT G337:** Strike 28,98 → 5,36% abaixo do preço atual.Esses dois valores devem ser inseridos como **Call (%)** e **Put (%)** na ferramenta.
- Prêmio (%) recebido:**
Localizado na área inferior à esquerda, no painel da estratégia.
Exemplo da imagem: **2,75%** de prêmio total sobre o valor da ação. Esse valor representa a soma dos prêmios das opções CALL e PUT vendidas.

5. Análise Estatística dos Resultados

A ferramenta **Stratium Backtester** apresenta um resumo detalhado das operações simuladas, com base nas entradas configuradas. A imagem abaixo exemplifica esse relatório:



Explicando os campos:

- **Total de Operações:** Quantidade de strangles simulados com os critérios definidos.
- **Resultado Total:** Lucro ou prejuízo acumulado ao longo de todas as operações.
- **Resultado Médio:** Média de resultado por operação.
- **Taxa de Acerto:** Percentual de operações que **fecharam dentro do range** definido.

6. Análise de Operações

- **Operações que fecharam DENTRO do range:**
Quantas operações **finalizaram no vencimento** com o preço da ação **entre os strikes de CALL e PUT** (dentro do intervalo do strangle).
→ No exemplo da imagem: 10 de 11 operações (91%).
 - **Operações que ultrapassaram o range:**
Número de operações em que o preço da ação **rompeu o range** (para cima ou para baixo) **em algum momento durante a vigência da operação**, mas **não necessariamente terminou fora**.
→ No exemplo: 5 de 11 operações (45%).
-

Detalhamento de ultrapassagem:

- **Apenas para cima:** O preço ultrapassou o strike da CALL, mas **não chegou a romper a PUT**.
→ Exemplo: 3 operações.
- **Apenas para baixo:** O preço caiu abaixo do strike da PUT, mas **não rompeu o da CALL**.
→ Exemplo: 2 operações.
- **Para ambos os lados:** O preço rompeu **os dois extremos do range**, ou seja, saiu pela CALL e voltou rompendo a PUT (ou vice-versa).
→ Exemplo: 0 operações.

7. Histórico de Trades

A ferramenta Stratium apresenta um **resumo detalhado de cada operação**, com os principais dados que ajudam na análise individual do desempenho de cada strangle.

Histórico de Trades



ABERTURA	FECHAMENTO	MUDANÇA DE PREÇOS	FUROU RANGE	RESULTADO	RESULTADO %	DIAS	SAÍDA ANTECIPADA
13/06/2024	01/07/2024	0.59%	⇄	R\$ 134,91	77.63%	12	✓
11/07/2024	30/07/2024	1.59%	↑	R\$ 124,94	68.13%	13	✓
15/08/2024	06/09/2024	7.30%	↑	-R\$ 325,66	-165.09%	16	✗
12/09/2024	25/09/2024	-1.67%	↓	R\$ 155,23	74.22%	9	✓

Entendendo cada coluna:

- **Abertura / Fechamento:**
Datas em que a operação foi iniciada e encerrada.
- **Mudança de Preços:**
Variação percentual do preço da ação desde a **abertura até o fechamento da operação**.
 - Se o valor estiver em **verde ou vermelho**, significa que o **preço final fechou fora do range** (ou seja, o preço da ação saiu do intervalo entre os strikes da CALL e da PUT no vencimento).
 - Se o valor estiver **preto**, o preço fechou **dentro do range**.

- **Furou o Range:**

Indica se o preço, em **algum momento da operação**, ultrapassou os limites do strangle:

-  Apenas para cima (CALL)
-  Apenas para baixo (PUT)
- ⇔ Ambos os lados (furou CALL e PUT)
- Nenhum ícone = preço permaneceu dentro do range o tempo todo

- **Resultado / Resultado %:**

Lucro ou prejuízo obtido com a operação, tanto em valor absoluto (R\$) quanto em percentual sobre o capital investido.

- **Dias:**

Quantidade de dias que a operação ficou aberta.

- **Saída Antecipada:**

✓ A saída antecipada foi realizada, ou seja, a operação foi encerrada antes do vencimento conforme o critério em **% de lucro** configurado.

✗ A operação foi levada até o vencimento.