

NOMOS ·

COCKPIT DO TRADER · GUIA PRÁTICO

GUIA 03

Interpretando seus Indicadores

Saber os números é metade do trabalho. A outra metade é decidir com eles — quando você está bem, quando precisa reduzir e quando precisa parar.

Ferramenta	Nível	Tempo
Dashboard de Edge	Decisão operacional	~12 min

Protocolos de gestão de risco educacionais. Não são recomendação de investimento.

DIAGNÓSTICO RÁPIDO

3 perguntas ao abrir o Dashboard

Todo início de análise, faça este checklist mental na ordem:

- 1 A Expectancy é positiva?**
 Sim → tem edge, pode seguir. Negativa → pare de aumentar tamanho e entenda o erro. Perto de zero → no limite, qualquer variação te coloca no negativo.
- 2 O Profit Factor está acima de 1,5?**
 Acima de 1,5 → saudável. Entre 1,0–1,5 → atenção. Abaixo de 1,0 → destruindo capital, pause e revise.
- 3 Win rate + risco/retorno fazem sentido juntos?**
 O win rate sozinho engana. É a combinação que conta — veja o exemplo abaixo.

Por que o win rate engana — dois exemplos

Cenário	Conta	Resultado esperado
60% win · RR 0,8 ganha 100, perde 125	$(60\% \times 100) - (40\% \times 125)$ = 60 – 50	+R\$10 / ciclo → tem edge
70% win · RR 0,5 ganha 100, perde 200	$(70\% \times 100) - (30\% \times 200)$ = 70 – 60	+R\$10 / ciclo → edge apertado

A LIÇÃO

Dois traders, win rates muito diferentes (60% vs 70%), **mesmo resultado**. O número que importa é a **expectancy** — não o acerto isolado.

DECISÃO DE TAMANHO

Quando reduzir e quando aumentar

A decisão mais importante não é o setup — é o tamanho da posição. Use os dados, não a emoção.

Reduza imediatamente se...

- ▼ **3+ perdas consecutivas.** A 4ª tende a ser emocional. Corte o tamanho pela metade até a estratégia retomar.
- ▼ **Expectancy caindo 2 meses seguidos** (ex.: R\$180 → R\$90 → R\$40). Algo mudou — reduza antes de identificar.
- ▼ **Operando fora do padrão.** Entradas sem setup, saídas por medo. O problema é execução — menor tamanho alivia a pressão.

Considere aumentar só se...

- ▲ **Profit Factor > 1,5 por 3 meses** consecutivos.
- ▲ **Expectancy positiva e estável** (não caindo).
- ▲ **Amostra significativa:** 50+ operações no período.
- ▲ **Gradualmente:** 100 → 130 → 150 ações. Nunca dobre de uma vez.

SINAL DE ALERTA

Se ao **aumentar o tamanho a performance piora**, isso é um dado: alguns traders perdem disciplina com valores maiores. O relatório mostra isso nos números — respeite o sinal.

PROTOCOLO, NÃO REGRA FIXA

Reduzir tamanho após sequência de perdas é **proteção de capital preventiva** enquanto você analisa — não uma lei universal. O objetivo é identificar antes que o mercado force.

ONDE CONCENTRAR ESFORÇO

Resultado por ativo

Operar muitos ativos esconde o que realmente funciona. A planilha separa — e a verdade às vezes surpreende.

● ● ● Relatório de Edge · Resultado por Ativo

Ativo	Operações	Win Rate	Profit Factor	Resultado
WINFUT	42	65%	2,1	+R\$8.400
PETR4	28	57%	1,6	+R\$3.100
MGLU3	19	47%	0,9	-R\$1.250

↑ MGLU3 tem Profit Factor abaixo de 1 — está drenando capital, mesmo o agregado sendo positivo.

DECISÃO ÓBVIA COM O DADO EM MÃOS

Pare de operar MGLU3 por um período e concentre em WINFUT. Revise se o problema em MGLU3 é o ativo ou o seu setup nele. Sem o relatório, esse prejuízo ficava invisível no resultado total.

Resumo das decisões deste guia

- Comecei pela **expectancy**, não pelo win rate
- Verifiquei o **profit factor** na tabela de faixas
- Defini se é momento de **reduzir, manter ou aumentar**
- Identifiquei o **ativo que drena capital** e ajustei o foco

Próximo passo

O **Guia 04** fecha o ciclo: o ritual semanal e o protocolo para **manter consistência** no longo prazo.