

NEW YORK BREAKER

Opening Range Breakout para US100/NAS100

Manual do Utilizador

Versão 1.02

João Jara de Carvalho

Índice

1. Introdução à estratégia
2. Como funciona o EA
3. Modos de Entrada (Novo na v1.02)
4. Configuração inicial
5. Parâmetros de input
6. Painel visual no gráfico
7. Gestão de risco
8. Perguntas frequentes
9. Aviso e suporte

1. Introdução à estratégia

O **New York Breaker** é um Expert Advisor que implementa a estratégia **Opening Range Breakout (ORB)** aplicada ao índice US100 (NAS100) durante a sessão de Nova Iorque.

A lógica é simples: nos primeiros 30 minutos da abertura da sessão NY, o EA marca o ponto mais alto (High) e o mais baixo (Low) do preço. Quando o preço rompe um destes extremos, o EA entra na direcção desse rompimento, com Stop Loss no lado oposto e Take Profit em múltiplos do risco assumido.

Esta abordagem aproveita a forte direcionalidade que tipicamente surge após os primeiros minutos da sessão NY, onde os grandes participantes do mercado (institucionais, market makers) montam as suas posições do dia.

Vantagens

- Risco fixo e controlado em cada trade — sem surpresas
- Sem martingale, sem grid, sem averaging
- Risk:Reward elevado (1:5, 1:10) — lucrativo mesmo com win rate baixo
- Filtros independentes para refinar a estratégia
- Funciona igualmente em backtest e em live
- Trailing stop e Break-Even configuráveis
- Painel visual no gráfico com toda a informação relevante

2. Como funciona o EA

Fases de funcionamento diário

Fase 1 — Construção do range: A partir das 16:15 (default), o EA começa a observar o preço durante os 30 minutos seguintes, registando o High e o Low desse intervalo.

Fase 2 — Espera pelo rompimento: Após o range estar definido (16:45), o EA aguarda o rompimento. Conforme o modo de entrada escolhido (ver capítulo 3), actua de formas diferentes.

Fase 3 — Em posição: Uma vez aberta a posição, o EA gere o Stop Loss (via trailing, break-even ou tighten) até atingir o Take Profit ou ser stoppado.

Fase 4 — Fim do dia: Às 18:00 (default) cancela ordens pendentes não accionadas. Às 23:00 fecha qualquer posição ainda aberta.

Filtros disponíveis

- **Filtro de Range:** só opera se o range estiver entre X% e Y% do preço
- **Filtro EMA:** só compra acima da EMA, só vende abaixo (configurável H4)
- **Filtro de Dias:** escolha individual dos dias da semana
- **Direcção:** apenas compras, apenas vendas, ou ambos
- **Máximo de trades por dia:** 1 ou 2 (segundo só após perda do primeiro)

3. Modos de Entrada

Novidade na versão 1.02: agora podes escolher entre três modos diferentes de entrada quando o preço rompe o range. Cada modo tem vantagens próprias.

3.1 PENDING STOP (default)

Comportamento original do EA. Após o range estar definido, o EA coloca duas ordens pendentes:

- Buy Stop ligeiramente acima do range High
- Sell Stop ligeiramente abaixo do range Low

Quando o preço atinge uma destas linhas, a ordem dispara automaticamente. É o método clássico, com execução imediata no momento exacto do rompimento.

Vantagens:

- Execução instantânea — entra exactamente no preço definido
- Funciona mesmo se desconectado momentaneamente do servidor
- Resultados de backtest mais previsíveis

Desvantagens:

- Em momentos de gap ou spike, pode haver slippage
- Entra mesmo em fake breakouts (rompimentos falsos que revertem)

3.2 MARKET TOUCH

Em vez de ordens pendentes, o EA fica a observar o preço em tempo real. Quando o preço **toca** o range High (compra) ou range Low (venda), envia imediatamente uma ordem de mercado.

Vantagens:

- Útil em brokers com problemas em ordens pendentes
- Permite controlar slippage máximo (ver Max Spread Points)

Desvantagens:

- Requer ligação estável ao servidor (VPS recomendado)
- Comportamento idêntico ao Pending Stop em condições normais

3.3 MARKET CLOSE (mais conservador)

O EA espera pelo **fecho** de uma candle além do range antes de entrar. Esta confirmação filtra fake breakouts onde o preço pica acima/abaixo do range mas fecha de volta dentro.

Vantagens:

- Filtra fake breakouts — muito comuns na abertura da sessão
- Tipicamente aumenta o win rate
- Configurável: 1, 2 ou 3 candles de confirmação

Desvantagens:

- Entra a um preço pior que o do toque inicial
- Pode reduzir o número total de trades

Recomendação: mantenha PENDING STOP se quiser replicar os resultados do backtest documentado. Os modos MARKET são para experimentação ou ajuste ao seu broker específico.

4. Configuração inicial

Símbolos suportados

O EA foi desenvolvido e otimizado para o **US100 / NAS100 / NASDAQ-100**. O nome do símbolo varia conforme o broker:

- ICMarkets: **USTEC**
- Pepperstone: **NAS100**
- IC Trading: **USTEC**
- Outros brokers: **US100, NDX, NQ**

O EA detecta automaticamente o símbolo e ajusta o seu funcionamento. Em outros símbolos (forex, ouro) também funciona, mas sem otimização específica.

Timeframe recomendado

M15 (15 minutos). Outros timeframes funcionam mas não foram testados exaustivamente.

Sessão de Nova Iorque

A sessão NY abre às 9:30 EST (hora de Nova Iorque). Em horário de servidor MT5 (geralmente GMT+2/GMT+3), isto traduz-se em:

- Verão (EDT, GMT-4): servidor às 15:30 (se servidor GMT+2) ou 16:30 (GMT+3)
- Inverno (EST, GMT-5): servidor às 16:30 (GMT+2) ou 17:30 (GMT+3)

Default do EA: 16:15 (servidor) — aplicável a brokers comuns como ICMarkets/Pepperstone. Confirme o seu broker e ajuste se necessário.

5. Parâmetros de input

5.1 Sessão NY

| Parâmetro | Default | Descrição |
|------------------|---------|---|
| InpSessionHour | 16 | Hora de início da sessão NY |
| InpSessionMinute | 15 | Minutos da hora de início |
| InpRangeMinutes | 30 | Duração do range (15, 30 ou 60 min) |
| InpCancelHour | 18 | Hora para cancelar ordens pendentes (0=nunca) |
| InpCloseHour | 23 | Hora para fechar posições (0=nunca) |

5.2 Modo de Entrada (Novo v1.02)

| Parâmetro | Default | Descrição |
|--------------------|--------------|--|
| InpEntryMode | PENDING_STOP | Pending Stop / Market Touch / Market Close |
| InpMaxSpreadPoints | 0 | Spread máximo em pontos (0=sem limite) |
| InpConfirmCandles | 1 | Candles para confirmar Market Close (1-3) |

5.3 Gestão de Risco

| Parâmetro | Default | Descrição |
|----------------|---------|---|
| InpRiskPercent | 0.5 | Risco por trade em % da conta |
| InpRiskReward | 10 | Rácio Risco:Recompensa (TP = SL x este valor) |
| InpSLRangePct | 100 | SL como % do range (100=lado oposto) |
| InpTradeDir | Both | Direcção: Both, Buy only, Sell only |
| InpMaxTrades | MAX_TWO | Trades máximos por dia (1 ou 2) |

5.4 Trailing Stop

| Parâmetro | Default | Descrição |
|---------------------|--------------|---------------------------------------|
| InpUseTrailingStop | true | Activar trailing stop |
| InpTrailMode | Fixed Points | Pontos fixos ou % do range |
| InpTrailingStep | 100 | Distância do trailing em pontos |
| InpTrailRangePct | 100 | Distância do trailing como % do range |
| InpTrailActivatePct | 200 | Activa quando profit = X% do range |

5.5 Filtros

| Parâmetro | Default | Descrição |
|-------------------|---------|-------------------------------------|
| InpUseRangeFilter | false | Activar filtro de tamanho do range |
| InpMinRangePct | 0.1 | Range mínimo aceitável (% do preço) |
| InpMaxRangePct | 2.0 | Range máximo aceitável (% do preço) |
| InpUseTrendFilter | true | Activar filtro EMA |
| InpEMAPeriod | 50 | Período da EMA |
| InpEMATF | H4 | Timeframe da EMA |

5.6 Geral

| Parâmetro | Default | Descrição |
|----------------|----------------|------------------------------------|
| InpEAComent | New York Break | Comentário nas ordens |
| InpMagicNumber | 202401 | Magic number do EA |
| InpSlippage | 10 | Slippage máximo permitido (pontos) |
| InpShowPanel | true | Mostrar painel visual no gráfico |

6. Painel visual no gráfico

Quando o EA está em execução, mostra um painel no canto superior esquerdo do gráfico com toda a informação relevante:

- **Status:** Estado actual (Waiting, Building range, Orders active, In position)
- **Range High/Low:** Valores do range actual
- **Range size:** Tamanho do range em pontos e em %
- **Risk:** Valor em \$ a arriscar no próximo trade
- **Direction:** Direcções permitidas (Both/Buy/Sell)
- **RR:** Rácio Risk:Reward configurado
- **Entry mode:** Modo de entrada activo (novo na v1.02)
- **Filters:** Estado dos filtros (EMA, Range, Day)
- **Trades today:** Contador de trades do dia (X/Max)

7. Gestão de risco

Cálculo do tamanho da posição

O lote é calculado automaticamente para que cada trade arrisque exactamente **InpRiskPercent** % do saldo da conta. Por exemplo:

- Conta: \$10.000 | Risco: 0.5% = \$50 por trade
- Range: 100 pontos | SL = 100 pontos
- Lote calculado para que 100 pontos × Lote = \$50

Conselhos práticos

- Comece com o risco padrão de **0.5%**. Não aumente até estar confortável.
- Use **conta demo** primeiro durante pelo menos 2-4 semanas.
- Não combine este EA com outros na mesma conta sem perceber o impacto.
- Use um **VPS estável** para evitar perdas por desligamentos.
- Acompanhe o EA mas **não interfira** em trades — deixe-o correr.

8. Perguntas frequentes

O EA funciona em conta hedging ou netting?

Em ambas. O código foi desenhado para detectar e adaptar-se.

Posso correr múltiplas instâncias em diferentes símbolos?

Sim, mas use Magic Numbers diferentes em cada instância para evitar conflitos.

O que acontece se o computador desligar a meio de uma sessão?

Ordens pendentes ou posições abertas continuam no servidor do broker. Quando o EA voltar a estar online, retoma a gestão delas. Recomendamos usar VPS para máxima estabilidade.

Como sei qual a sessão NY correcta para o meu broker?

Confirme com o broker o horário do servidor. A sessão NY abre às 9:30 EST. Some o offset do servidor para obter a hora local. Em ICMarkets/Pepperstone (servidor GMT+3), o default 16:15 funciona durante todo o ano (eles ajustam DST).

Posso otimizar os parâmetros?

Sim, mas com cuidado. Optimização excessiva = overfitting. Os defaults já estão ajustados para o US100. Se mudar broker, pode ser necessário ajustar ligeiramente o horário de início.

O backtest dá X resultados, vou obter o mesmo em live?

Não exactamente. Backtest é uma boa estimativa mas em live há slippage, spreads variáveis, news e outros factores que podem fazer os resultados divergirem. Use sempre conta demo primeiro.

Qual a diferença entre Trailing, Break-Even e Tighten?

Trailing: move o SL atrás do preço continuamente. Break-Even: move o SL para o preço de entrada quando o trade está em lucro. Tighten: move o SL para um R-multiple positivo, garantindo lucro mínimo.

9. Aviso e suporte

Aviso de risco

Trading envolve risco substancial e pode resultar na perda total do capital investido. Resultados passados não garantem resultados futuros. Os backtests apresentados foram realizados em condições idealizadas (ticks reais, demo) e os resultados em conta real podem variar significativamente devido a slippage, spreads variáveis, comissões e outros factores.

Este EA não é um conselho financeiro. É uma ferramenta de execução. É da sua inteira responsabilidade usar apenas capital que pode permitir-se perder, começar com risco baixo, testar adequadamente em demo, e parar imediatamente se o EA não estiver a funcionar como esperado.

Suporte

Em caso de dúvidas, problemas ou pedidos de ficheiros .set optimizados, contacte através de:

- Comentários do produto no MQL5 Market
- Mensagem privada via [mql5.com](https://www.mql5.com)
- Profile: João Jara de Carvalho

Boa sorte com o seu trading. Trade com disciplina, gerencia o risco, e lembra-se: trading é uma maratona, não um sprint.