
CLOUD

UMA CARTEIRA DE ROBÔS ATEMPORAIS
FEITA PARA VOCÊ!



Sumário

Estratégia

Resultados

Correlação

Parametrização

Contato



CLOUD é uma estratégia que contém carteiras de robôs atemporais para operar no mini índice, em sua maioria são trades longos a favor da tendência.

O que seria um robô atemporal?

Atemporal é um adjetivo usado para qualificar algo ou alguém que não é afetado pelo passar do tempo, ou seja, que faz parte de qualquer época ou tempo. ... Que não pode ser controlado pelo tempo; que não faz parte de um tempo determinado; intemporal.

Portanto um robô atemporal se adequa a qualquer tipo de mercado, porque ao longo dos anos passou por diversas situações. Os robôs da estratégia **CLOUD**, como você poderá ver nas páginas seguintes, possuem registros de todos os semestres positivos desde 2018.

É importante frisar que lucros passados jamais serão garantia de resultados futuros.

Contudo, alguns robôs dessa carteira vem sendo utilizada em conta real e simulada desde o início do ano de 2020 e vem mostrando a mesma consistência apresentadas nos registros de anos anteriores.

Esse fato ocorre porque a a carteira de robôs CLOUD foi desenvolvida para buscar alvos longos e fazer poucas operações no mês. Isso faz com que aumente sua confiabilidade em relação ao backtest e em relação a outras estratégias que fazem diversas operações no dia sempre se expondo por mais vezes ao risco do mercado.

Além disso, para manter todos os meses positivo desde janeiro de 2018, a estratégia utiliza horários, indicadores e sentidos variados como forma de diversificação que potencializa sua consistência.

| | | | |
|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|
| Médias Móveis ⓘ | Habilita Inversão ⓘ | Modo de Operação ⓘ | Forma de uso ⓘ |
| <input checked="" type="checkbox"/> | <input checked="" type="checkbox"/> | Apenas entradas ▾ | Cruzamento das médias ▾ |
| Média curta: Tipo ⓘ | Média curta: Número de períodos ⓘ * | Média curta: Deslocamento ⓘ * | Média curta: Valor usado ⓘ |
| Exponencial ▾ | 9 | 0 | Fechamento ▾ |
| Média longa: Tipo ⓘ | Média longa: Número de períodos ⓘ * | Média longa: Deslocamento ⓘ * | Média longa: Valor usado ⓘ |
| Simples ▾ | 40 | 0 | Fechamento ▾ |

Restrições de Horário

Horário inicial para abrir posições

Horário final para abrir posições

Horário inicial

09:59

Horário final

16:30

São ao todo 10 diferentes estratégias, que iniciam em horários diversos e cada uma com seus gatilhos de entradas.

RESULTADOS



No momento a estratégia possui 10 robôs, a carteira é composta por 5 robôs, logo, temos algumas opções de combinações variadas.

Vejamos agora um exemplo de carteira de cinco robôs.

Aqui temos os backtests da carteira no ano de 2018

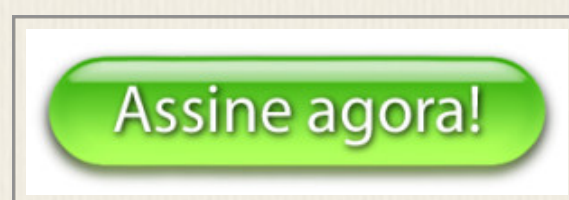
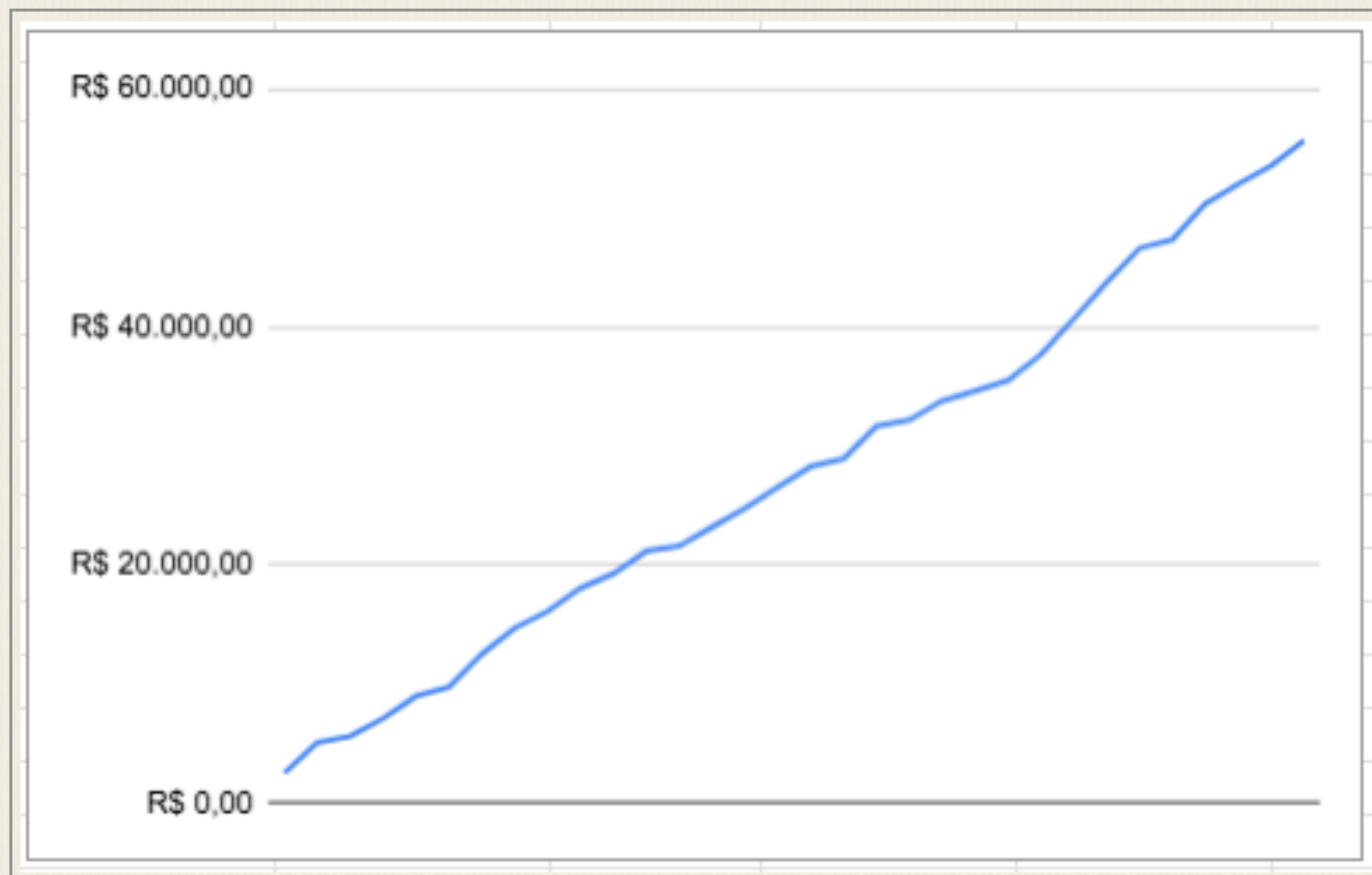
| ANO | Cloud | Organics | Butterfly Edge | Nail Bat | Mythril Saber | Total |
|-------------|--------------|--------------|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 2018 | | | | | | |
| Janeiro | R\$ 84,40 | R\$ 185,00 | R\$ 262,60 | R\$ 20,20 | R\$ 426,80 | R\$ 979,00 |
| fevereiro | R\$ 401,00 | R\$ 244,80 | -R\$ 7,20 | R\$ 425,60 | R\$ 455,80 | R\$ 1.520,00 |
| março | R\$ 344,00 | R\$ 633,00 | R\$ 249,40 | R\$ 467,80 | R\$ 388,20 | R\$ 2.082,40 |
| abril | R\$ 47,60 | R\$ 279,40 | -R\$ 286,80 | R\$ 334,00 | R\$ 106,60 | R\$ 480,80 |
| maio | R\$ 70,80 | R\$ 378,60 | R\$ 691,80 | R\$ 266,60 | R\$ 109,40 | R\$ 1.517,20 |
| junho | R\$ 458,00 | R\$ 671,60 | R\$ 404,00 | R\$ 2,60 | R\$ 206,80 | R\$ 1.743,00 |
| julho | R\$ 207,20 | R\$ 425,00 | R\$ 513,80 | -R\$ 131,20 | -R\$ 283,00 | R\$ 731,80 |
| agosto | R\$ 603,40 | R\$ 355,40 | R\$ 910,60 | R\$ 349,40 | R\$ 490,80 | R\$ 2.709,60 |
| setembro | R\$ 118,80 | R\$ 443,00 | R\$ 963,60 | R\$ 306,20 | R\$ 376,20 | R\$ 2.207,80 |
| outubro | R\$ 708,60 | R\$ 246,20 | R\$ 119,40 | R\$ 316,00 | R\$ 132,00 | R\$ 1.522,20 |
| novembro | R\$ 311,60 | R\$ 889,20 | R\$ 93,20 | -R\$ 199,80 | R\$ 782,80 | R\$ 1.877,00 |
| dezembro | R\$ 242,20 | R\$ 183,00 | R\$ 161,00 | R\$ 524,80 | R\$ 494,40 | R\$ 1.605,40 |
| | | | | | | |
| Total | R\$ 3.597,60 | R\$ 4.934,20 | R\$ 4.075,40 | R\$ 2.682,20 | R\$ 3.686,80 | R\$ 18.976,20 |

Na imagem abaixo podemos visualizar os backtests da carteira no ano de 2019 e 2020. No segundo semestre de 2020 temos o resultado de alguns robôs rodando em conta simulada e real.

| ANO | Cloud | Organics | Butterfly Edge | Nail Bat | Mythril Saber | Total |
|--------------|--------------|--------------|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 2019 | | | | | | |
| Janeiro | R\$ 128,00 | R\$ 89,20 | R\$ 852,00 | R\$ 144,40 | R\$ 41,20 | R\$ 1.254,80 |
| fevereiro | R\$ 124,80 | R\$ 514,00 | R\$ 1,00 | R\$ 168,40 | -R\$ 183,00 | R\$ 625,20 |
| março | R\$ 317,60 | R\$ 209,00 | R\$ 534,20 | R\$ 199,40 | R\$ 441,60 | R\$ 1.701,80 |
| abril | R\$ 611,80 | R\$ 156,00 | R\$ 390,00 | R\$ 74,80 | R\$ 59,00 | R\$ 1.291,60 |
| maio | R\$ 65,60 | R\$ 455,20 | -R\$ 42,40 | R\$ 482,40 | R\$ 689,00 | R\$ 1.649,80 |
| junho | R\$ 24,80 | R\$ 761,20 | R\$ 313,80 | R\$ 628,00 | R\$ 55,40 | R\$ 1.783,20 |
| julho | -R\$ 84,20 | R\$ 500,00 | -R\$ 46,60 | -R\$ 198,00 | R\$ 275,20 | R\$ 446,40 |
| agosto | R\$ 306,80 | R\$ 485,20 | R\$ 675,80 | R\$ 948,80 | R\$ 598,20 | R\$ 3.014,80 |
| setembro | R\$ 95,00 | R\$ 343,20 | R\$ 493,40 | R\$ 557,00 | -R\$ 19,80 | R\$ 1.468,80 |
| outubro | R\$ 913,00 | R\$ 25,60 | -R\$ 260,40 | R\$ 100,40 | R\$ 707,60 | R\$ 1.486,20 |
| novembro | -R\$ 68,20 | R\$ 121,80 | R\$ 41,60 | R\$ 1.119,40 | -R\$ 411,20 | R\$ 803,40 |
| dezembro | R\$ 248,80 | -R\$ 51,40 | R\$ 197,80 | R\$ 26,20 | R\$ 254,80 | R\$ 676,20 |
| | | | | | | |
| Total | R\$ 2.683,80 | R\$ 3.609,00 | R\$ 3.150,20 | R\$ 4.251,20 | R\$ 2.508,00 | R\$ 16.202,20 |

| ANO | Cloud | Organics | Butterfly Edge | Nail Bat | Mythril Saber | Total |
|--------------|--------------|--------------|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 2020 | | | | | | |
| Janeiro | R\$ 769,40 | R\$ 568,00 | R\$ 213,60 | R\$ 853,20 | -R\$ 252,60 | R\$ 2.151,60 |
| fevereiro | R\$ 635,00 | R\$ 805,40 | R\$ 183,20 | R\$ 564,80 | R\$ 488,80 | R\$ 2.677,20 |
| março | R\$ 82,40 | R\$ 2.071,60 | R\$ 231,40 | R\$ 205,20 | R\$ 96,60 | R\$ 2.687,20 |
| abril | R\$ 226,20 | R\$ 885,60 | R\$ 1.127,80 | R\$ 463,60 | R\$ 435,00 | R\$ 3.138,20 |
| maio | -R\$ 88,40 | -R\$ 64,80 | R\$ 108,00 | R\$ 257,40 | R\$ 326,40 | R\$ 538,60 |
| junho | R\$ 652,40 | R\$ 1.193,20 | R\$ 605,60 | R\$ 287,60 | R\$ 345,60 | R\$ 3.084,40 |
| julho | R\$ 399,20 | R\$ 572,00 | -R\$ 208,20 | R\$ 430,00 | R\$ 693,20 | R\$ 1.886,20 |
| agosto | R\$ 154,80 | R\$ 769,20 | R\$ 326,40 | R\$ 216,60 | R\$ 37,80 | R\$ 1.504,80 |
| setembro | R\$ 1.050,60 | R\$ 954,20 | -R\$ 183,60 | R\$ 32,40 | R\$ 183,20 | R\$ 2.036,80 |
| outubro | R\$ 557,20 | R\$ 435,60 | R\$ 432,40 | R\$ 711,00 | -R\$ 241,60 | R\$ 1.894,60 |
| novembro | R\$ 241,00 | R\$ 134,30 | R\$ 145,80 | R\$ 281,60 | R\$ 211,20 | R\$ 1.013,90 |
| dezembro | | | | | | R\$ 0,00 |
| | | | | | | |
| Total | R\$ 4.679,80 | R\$ 8.324,30 | R\$ 2.982,40 | R\$ 4.303,40 | R\$ 2.323,60 | R\$ 22.613,50 |

Logo abaixo, podemos visualizar o crescimento da carteira desde o início em 2018.



Sempre é importante frisar que lucros passados jamais serão garantia de resultados futuros.



A correlação é uma medida estatística usada para determinar como ativos se movimentam com relação a outros.

Ela pode ser usada com ativos específicos (como por exemplo a correlação da ação de uma empresa em comparação a outra) ou ainda para comparar índices ou classes inteiras de ativos.

A correlação é medida em uma escala que vai do -1 ao +1.

Uma correlação perfeitamente positiva significa que dois ativos se comportam de maneira idêntica e é representada pelo +1.

Uma correlação perfeitamente negativa significa que dois ativos se comportam de maneira diretamente oposta e é representada pelo -1.

Correlação na construção de uma carteira de investimentos

A correlação é muito utilizada na construção de estratégias de investimento para mensurar a diversificação efetiva trazida por diferentes ativos de uma mesma carteira.

A Teoria Moderna do Portfólio usa uma medida da correlação entre todos os ativos de um portfólio para determinar a sua fronteira eficiente, ou seja, a carteira que melhor otimiza o retorno esperado para um determinado nível de risco.

Correlação dos robôs da estratégia

| | Apocalypse | Butterfly Edge | Cloud | Haven's Cloud | Murasame | Mythril Saber | Nail Bat | Organics | Rune Blade | Yukiyoshi |
|----------------|------------|----------------|-------|---------------|----------|---------------|----------|----------|------------|-----------|
| Apocalypse | 1 | -0,2 | 0,3 | 0,7 | 0,6 | 0,0 | 0,5 | 0,5 | 0,1 | 0,4 |
| Butterfly Edge | -0,2 | 1 | -0,1 | 0,0 | -0,1 | 0,0 | 0,0 | 0,1 | -0,3 | 0,0 |
| Cloud | 0,3 | -0,1 | 1 | 0,2 | 0,0 | 0,2 | 0,1 | -0,1 | 0,0 | 0,5 |
| Haven's Cloud | 0,7 | 0,0 | 0,2 | 1 | 0,8 | -0,1 | 0,2 | 0,6 | 0,2 | 0,3 |
| Murasame | 0,6 | -0,1 | 0,0 | 0,8 | 1 | -0,3 | 0,3 | 0,6 | 0,0 | 0,3 |
| Mythril Saber | 0,0 | 0,0 | 0,2 | -0,1 | -0,3 | 1 | -0,1 | 0,0 | 0,0 | -0,2 |
| Nail Bat | 0,5 | 0,0 | 0,1 | 0,2 | 0,3 | -0,1 | 1 | 0,1 | 0,0 | 0,4 |
| Organics | 0,5 | 0,1 | -0,1 | 0,6 | 0,6 | 0,0 | 0,1 | 1 | -0,1 | -0,1 |
| Rune Blade | 0,1 | -0,3 | 0,0 | 0,2 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | -0,1 | 1 | 0,0 |
| Yukiyoshi | 0,4 | 0,0 | 0,5 | 0,3 | 0,3 | -0,2 | 0,4 | -0,1 | 0,0 | 1 |

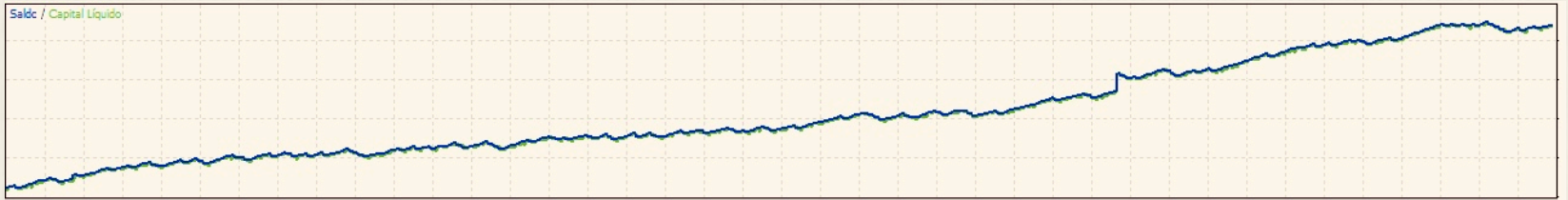
Correlação da Carteira

| | Butterfly Edge | Cloud | Mythril Saber | Nail Bat | Organics |
|----------------|----------------|-------|---------------|----------|----------|
| Butterfly Edge | 1 | -0,1 | 0,0 | 0,0 | 0,1 |
| Cloud | -0,1 | 1 | 0,2 | 0,1 | -0,1 |
| Mythril Saber | 0,0 | 0,2 | 1 | -0,1 | 0,0 |
| Nail Bat | 0,0 | 0,1 | -0,1 | 1 | 0,1 |
| Organics | 0,1 | -0,1 | 0,0 | 0,1 | 1 |

Ao incluir ativos de baixa correlação a uma carteira, diminui-se o risco total do portfólio. **Ou seja, busca-se obter o melhor retorno com o menor risco possível.**



Apocalypse



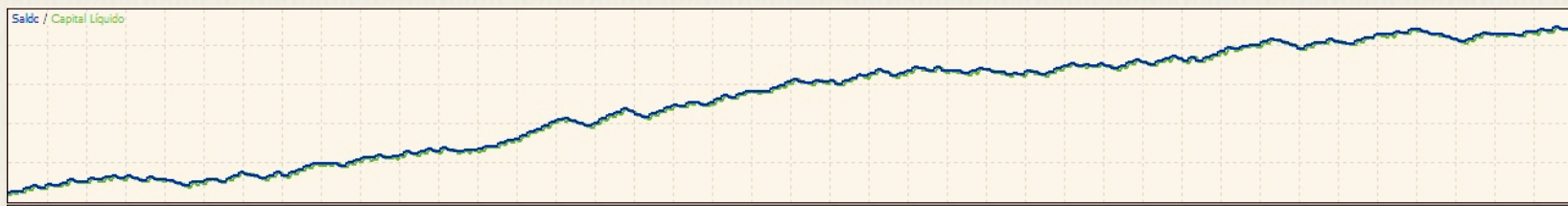
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 410 pontos
stop gain em 760 pontos
- **Stop loss:** 390
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Butterfly Edge



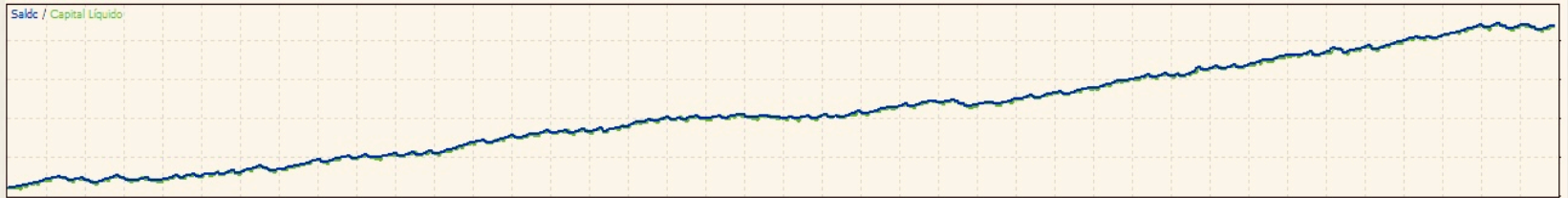
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 200 pontos
stop gain em 400 pontos
- **Stop loss:** 316
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Cloud



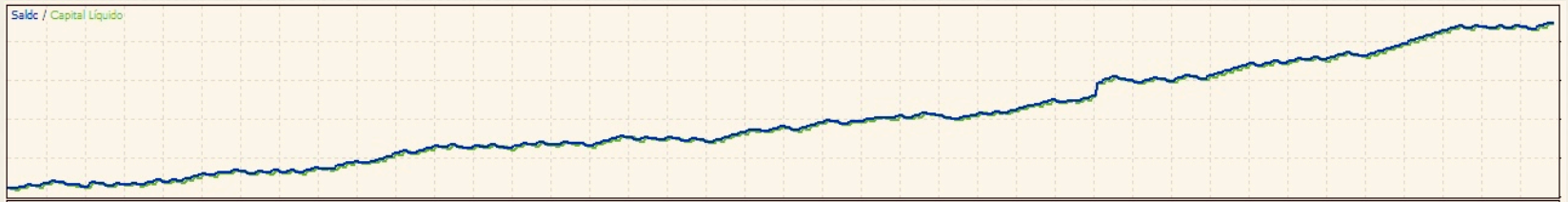
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 400 pontos
stop gain em 620 pontos
- **Stop loss:** 390
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Haven's Cloud



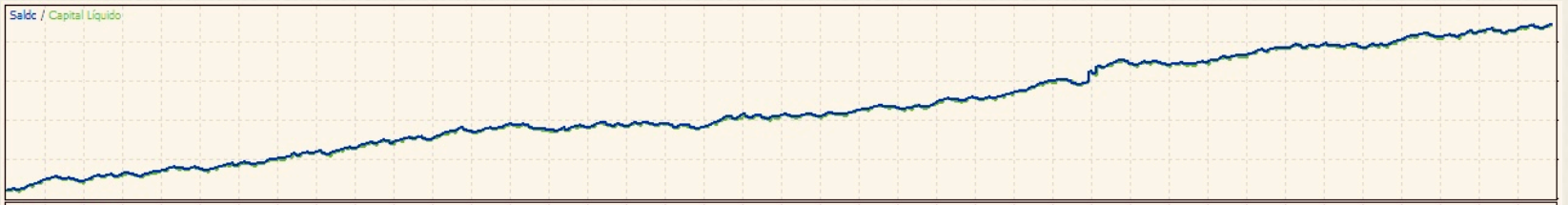
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 210 pontos
stop gain em 600 pontos
- **Stop loss:** 400
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Murasame



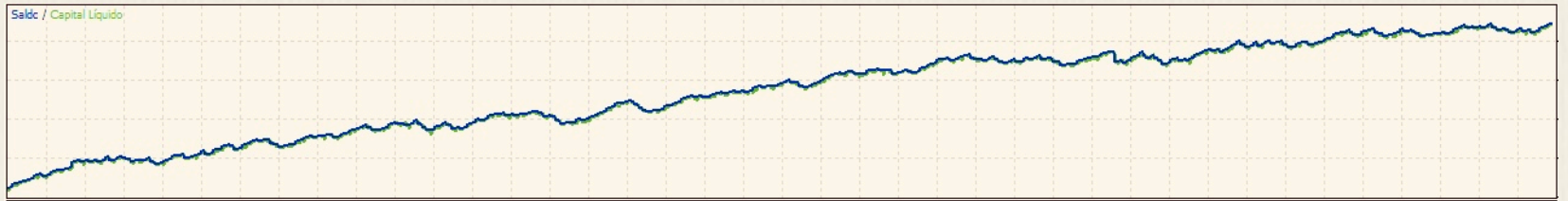
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 450 pontos
stop gain em 900 pontos
- **Stop loss:** 400
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Mythril Saber



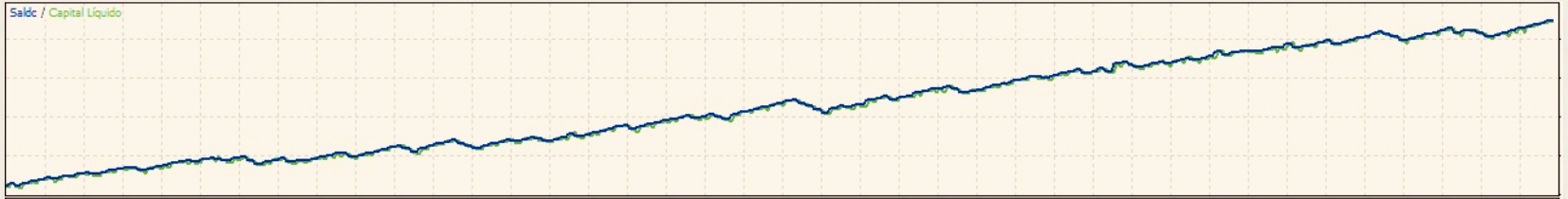
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 275 pontos
stop gain em 800 pontos
- **Stop loss:** 400
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Nail Bat



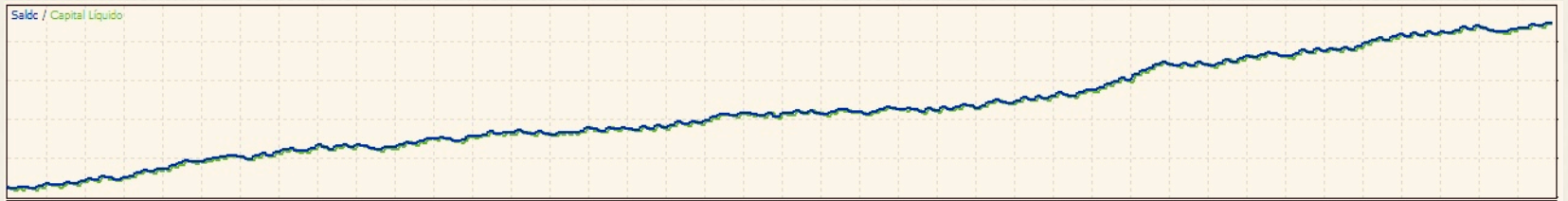
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 550 pontos
stop gain em 675 pontos
- **Stop loss:** 490
- **Número de trades:** Não definido



Organics



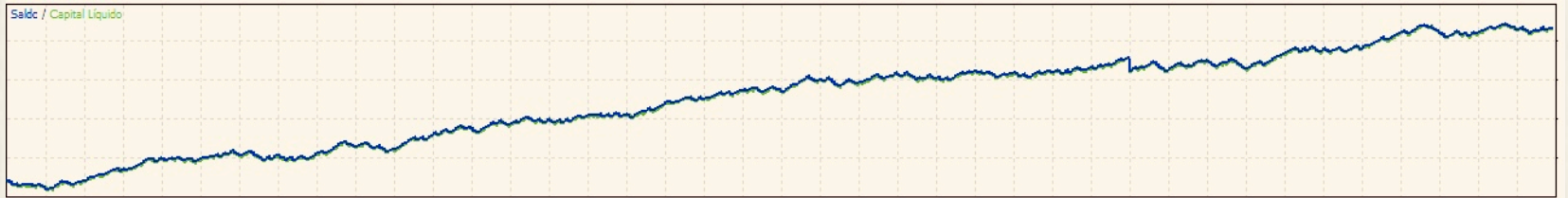
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 210 pontos
stop gain em 685 pontos
- **Stop loss:** 440
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Rune Blade



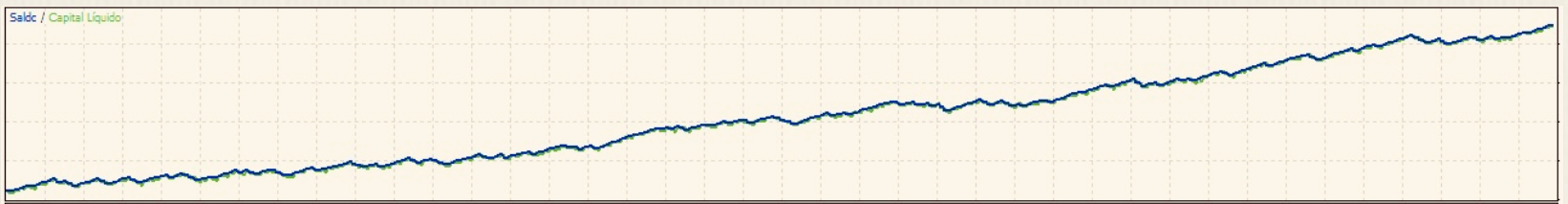
Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 700 pontos
stop gain em 1200 pontos
- **Stop loss:** 500
- **Número de trades:** 1 trade positivo ou negativo



Yukiyoshi

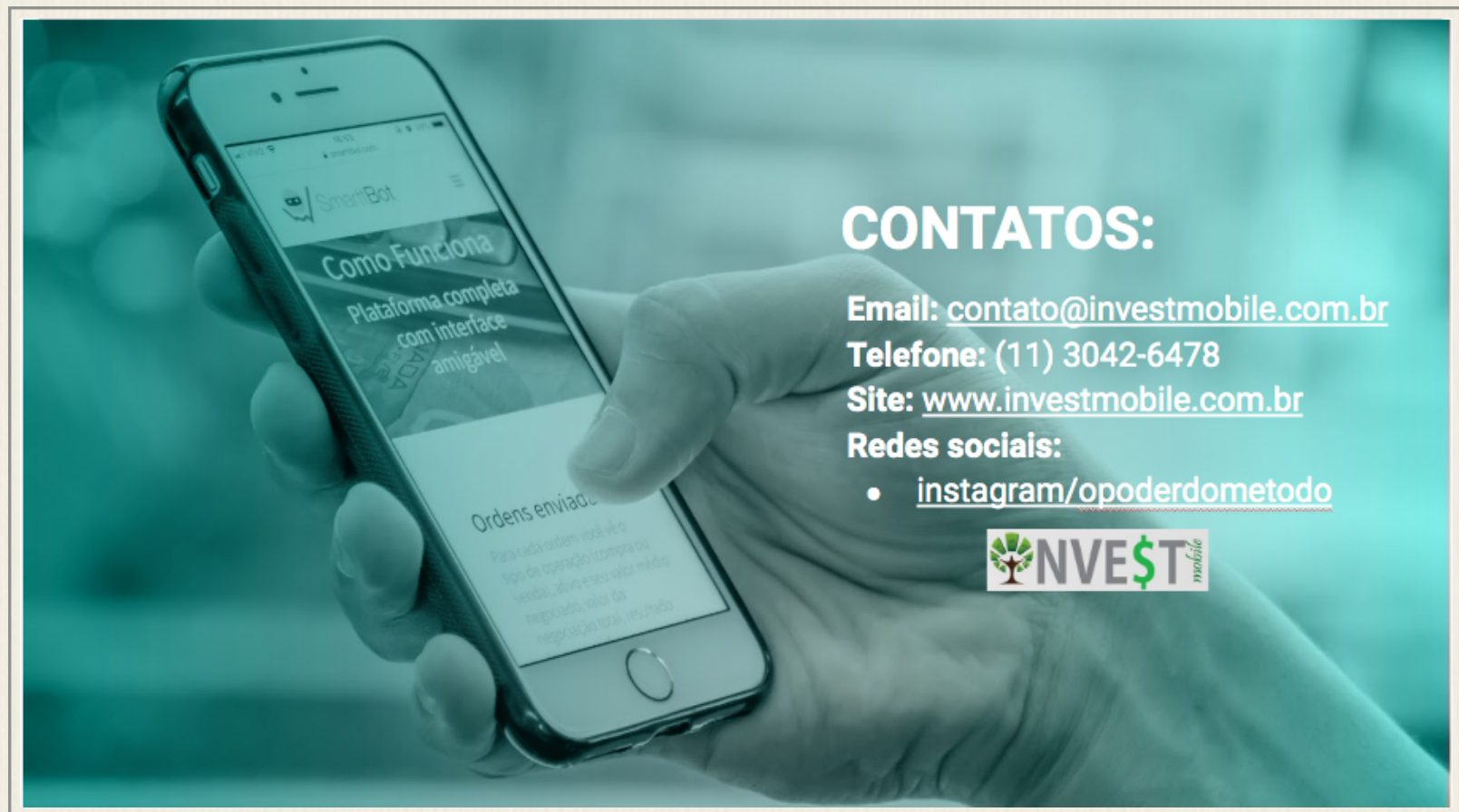


Backtests de 3 anos - 2018 á 2020

Configuração do robô

- **Capital sugerido:** R\$1000,00 por contrato
- **Stop gain:** parcial em 550 pontos
stop gain em 850 pontos
- **Stop loss:** 450
- **Número de trades:** 2 trade positivo ou negativo

CONTATO



DISCLAIMER

O conteúdo desse ebook é educacional. A parametrização e ativação do robô é de total responsabilidade do cliente. A SmarttBot é uma ferramenta para investidores e traders com o perfil de risco agressivo. Antes da utilização esteja ciente de todos os riscos. Para a utilização da estratégia em ambiente real, é necessário possuir a assinatura ativa de algum plano da SmarttBot. A quantidade de robôs e a exposição de contratos por robô também deverá respeitar os limites do seu plano SmarttBot