



CARTEIRA DE ROBÔS

A Revolução dos
Produtos Financeiros



Carteira Silver

Histórico moderado (média entre backtest otimista e simulador pessimista)

Período: 30/04/20 a 29/10/21 [[Acesso aos dados diários](#)]

Métricas de Retorno

- Retorno esperado diário: R\$ 34.28
- Fator de Lucro: 1.51
- Melhor pregão: R\$ 839
- Proporção de dias:
 - Positivos: 55%
 - Negativos: 45%
- Proporção de meses
 - Positivos: 89%
 - Negativos: 11%

Métricas de Risco

- Desvio-Padrão: R\$ 210.60
- Pior pregão: -R\$ 486
- Drawdown Máximo: -R\$ 1.359
- Duração média das janelas de drawdown: 39 dias
 - Duração média da queda: 17 dias
 - Duração média da recuperação: 22 dias

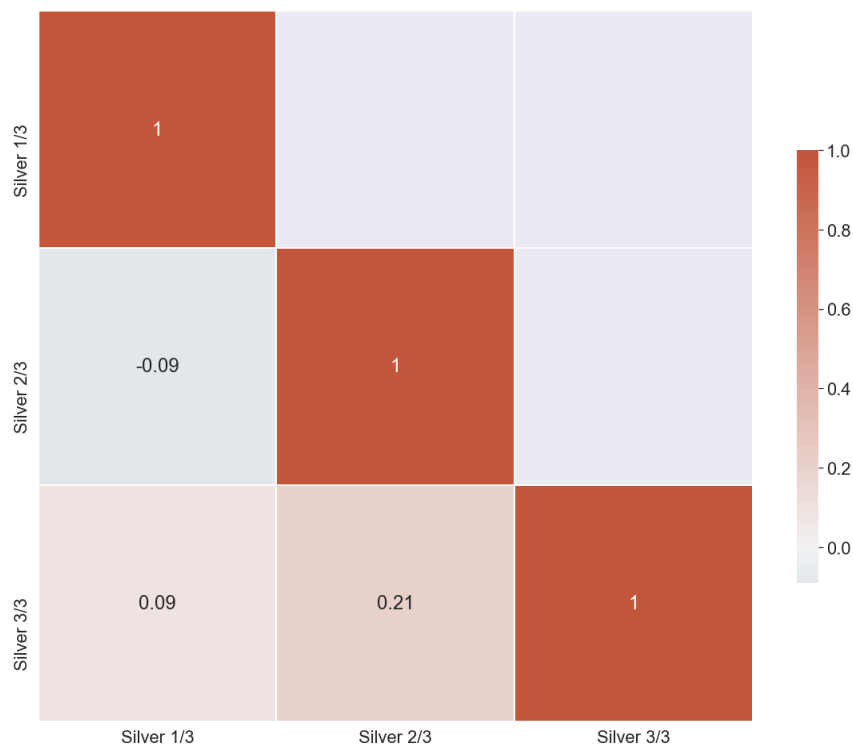
Momentos da Estatística

- Assimetria: 0.32
- Curtose: 0.14

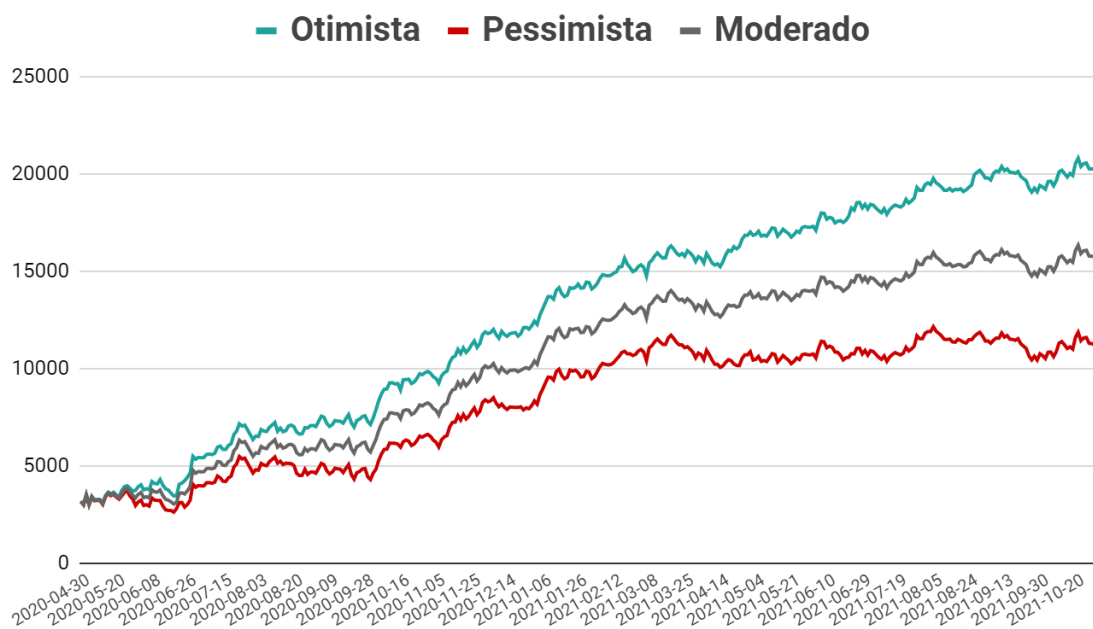
Características individuais dos Robôs

- Alvos médios (aprox 350 pts) a longos (aprox 1.000 pts)
- Frequência média de operações: 1 a 3 trades por dia

Matriz de Correlação



Curvas de Capital Silver: Cenários



Carteira Gold

Histórico moderado (média entre backtest otimista e simulador pessimista)

Período: 30/04/20 a 29/10/21 [[Acesso aos dados diários](#)]

Métricas de Retorno

- Retorno esperado diário: R\$ 106.13
- Fator de Lucro: 1.73
- Melhor pregão: R\$ 1.567
- Proporção de dias:
 - Positivos: 60%
 - Negativos: 40%
- Proporção de meses
 - Positivos: 72%
 - Negativos: 28%

Métricas de Risco

- Desvio-Padrão: R\$ 496.85
- Pior pregão: -R\$ 1.455
- Drawdown Máximo: -R\$ 3.003
- Duração média das janelas de drawdown: 39 dias
 - Duração média da queda: 20 dias
 - Duração média da recuperação: 18 dias

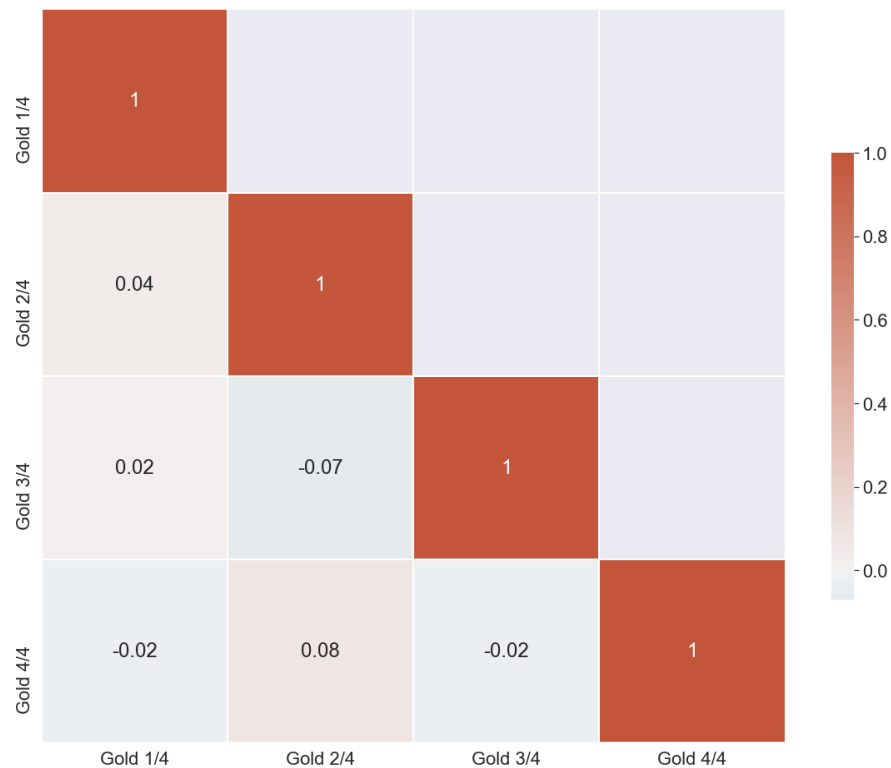
Momentos da Estatística

- Assimetria: 0.0
- Curtose: 0.2

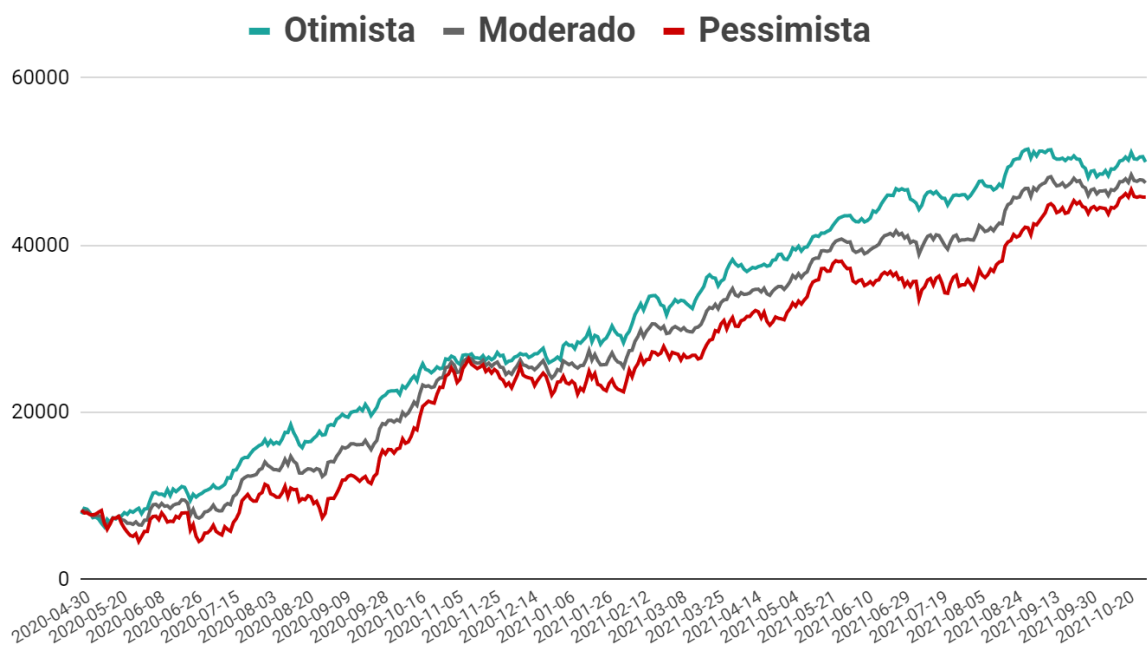
Características individuais dos Robôs

- WIN: Alvos longos (aprox 800 pts a 1.000 pts). Um deles inicia com 1 contrato e pode realizar aumento de posição para 2 contratos (exposição máxima).
- WDO: Alvos longos (aprox 20 pts a 40 pts)
- Frequência média de operações: 1 a 3 trades por dia

Matriz de Correlação



Curvas de Capital Gold: Cenários



Carteira Platinum

Histórico moderado (média entre backtest otimista e simulador pessimista)

Período: 30/04/20 a 29/10/21 [[Acesso aos dados diários](#)]

Métricas de Retorno

- Retorno esperado diário: R\$ 140.23
- Fator de Lucro: 1.64
- Melhor pregão: R\$ 1.567
- Proporção de dias:
 - Positivos: 54%
 - Negativos: 46%
- Proporção de meses
 - Positivos: 78%
 - Negativos: 22%

Métricas de Risco

- Desvio-Padrão: R\$ 720.64
- Pior pregão: -R\$ 1.763
- Drawdown Máximo: -R\$ 5.564
- Duração média das janelas de drawdown: 46 dias
 - Duração média da queda: 16 dias
 - Duração média da recuperação: 30 dias

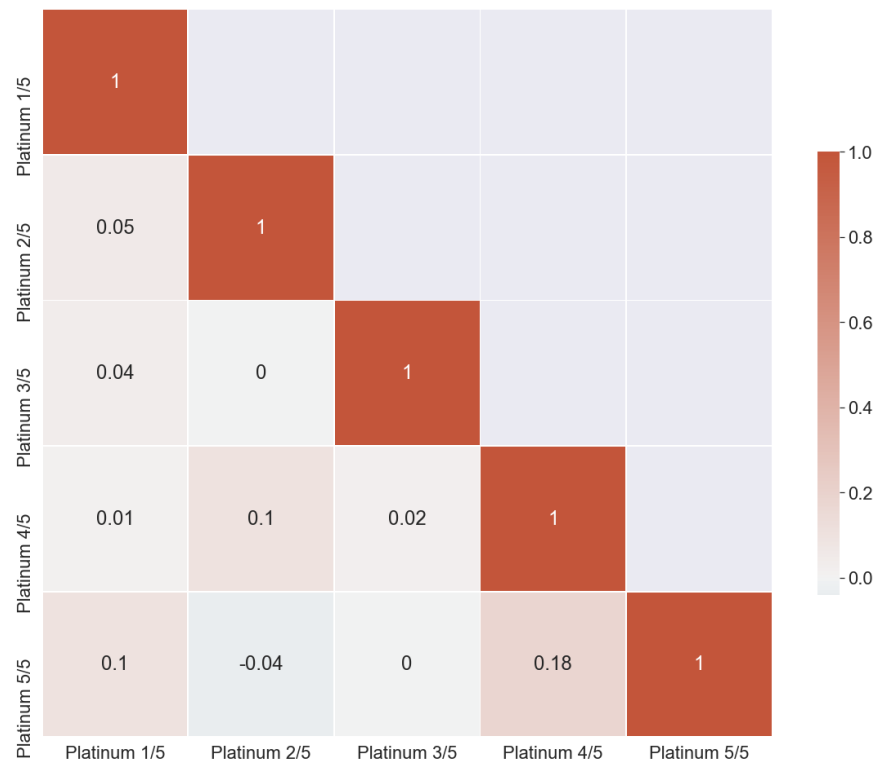
Momentos da Estatística

- Assimetria: 0.24
- Curtose: -0.07

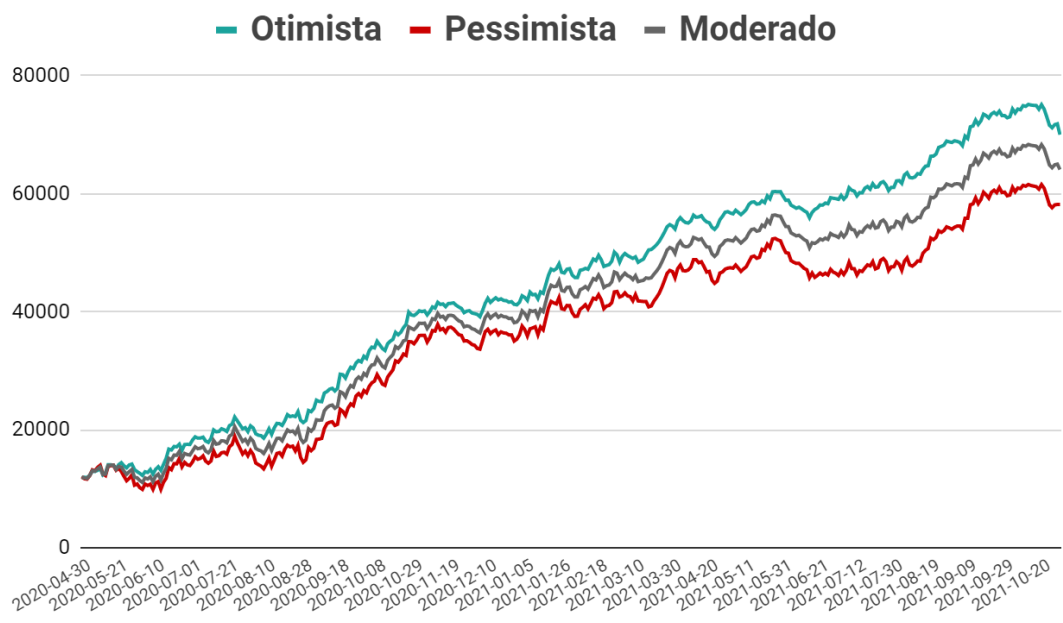
Características individuais dos Robôs

- WIN: Alvos longos (aprox 800 pts a 2.000 pts)
- WDO: Alvos longos (aprox 20 pts a 40 pts)
- Frequência média de operações: 1 a 3 trades por dia

Matriz de Correlação



Curvas de Capital Platinum: Cenários



Correlação entre as Carteiras

