

Comboio ONE

Análise e características estatísticas da carteira

Disclaimer:

"O investimento em renda variável pode ser altamente alavancado, apresentar alto nível de risco e pode não ser adequado para todas as pessoas. O investidor deve fazer operações neste tipo de mercado apenas se tiver experiência prévia e entender os riscos associados. Recomendamos que procure aconselhamento independente.

O conteúdo apresentado no site, documentos, informes, mídias sociais e canais de comunicação da FindMoney TM não se trata de recomendação, indicação e/ou aconselhamento de investimento, **sendo única e exclusiva responsabilidade do investidor a tomada de decisão**, apresentando apenas caráter educativo.

A FindMoney TM não recomenda ou oferece qualquer garantia sobre o futuro desempenho de qualquer sistema ou tecnologia.

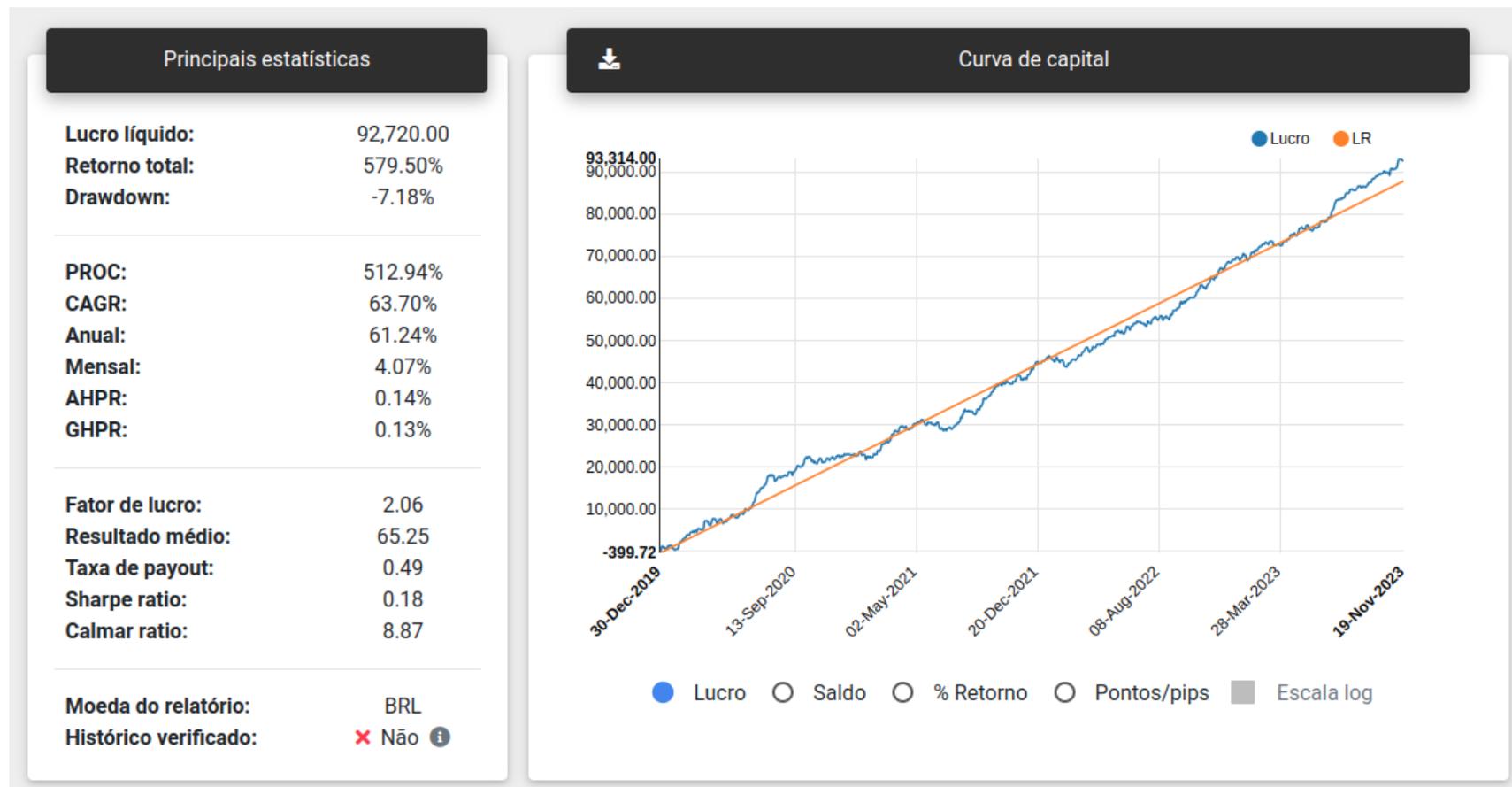
O investidor deve consultar seu próprio assessor ou conselheiro jurídico, tributário, regulatório, técnico, de negócios, de investimentos, financeiro e contábil, na medida em que julgar necessário, para assessoria na escolha e definição de softwares, plataformas, robôs, algoritmos, estratégias e setups."

O Comboio ONE é uma carteira formada pelos robôs: F-1000, Fusca, Onix e Uno, com uma exposição de 2 a 16 contratos. Coletivamente, esses quatro setups operam muito bem em conjunto suavizando a curva de capital (melhorando o *drawdown*) e o desempenho geral. Todos os gráficos gerados incluem os custos operacionais da B3, mas assumem corretagem zero.

Acesso ao sistema de assinaturas e paper trade: <https://app.smarttbot.com/smarttstore/detalhes/1161>



Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)



Média aproximada de lucro mensal: R\$ 1.900,00/mês (lembrando que houveram meses negativos)

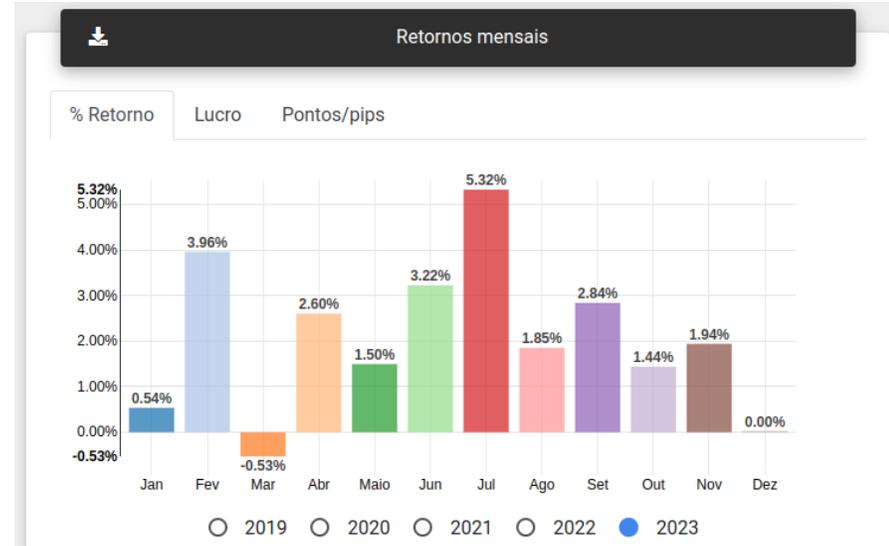
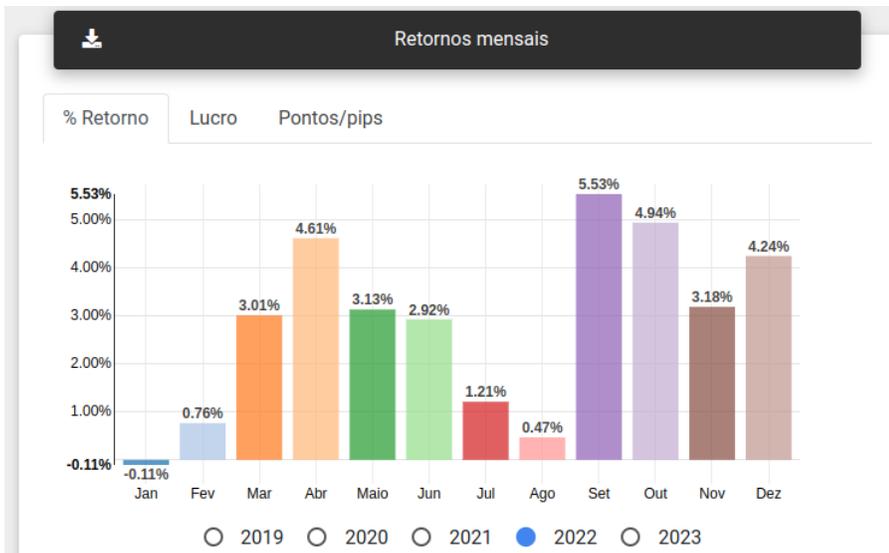
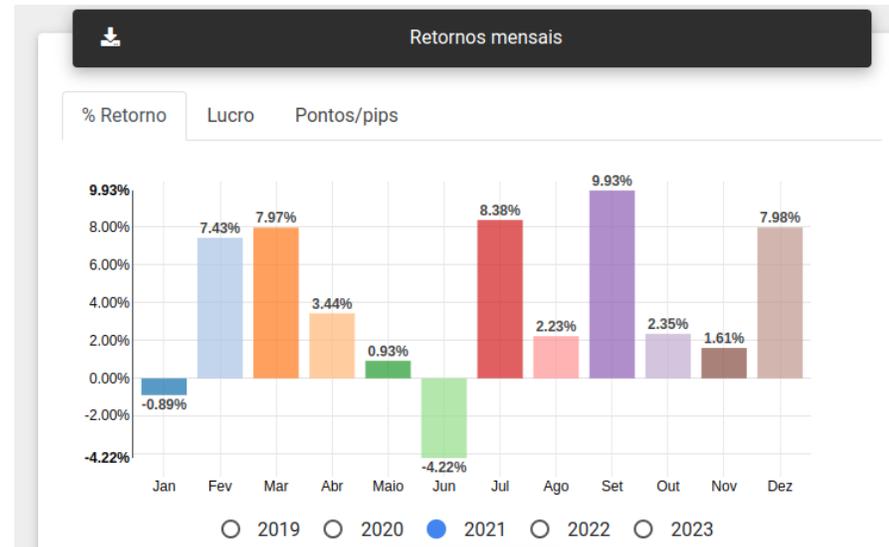
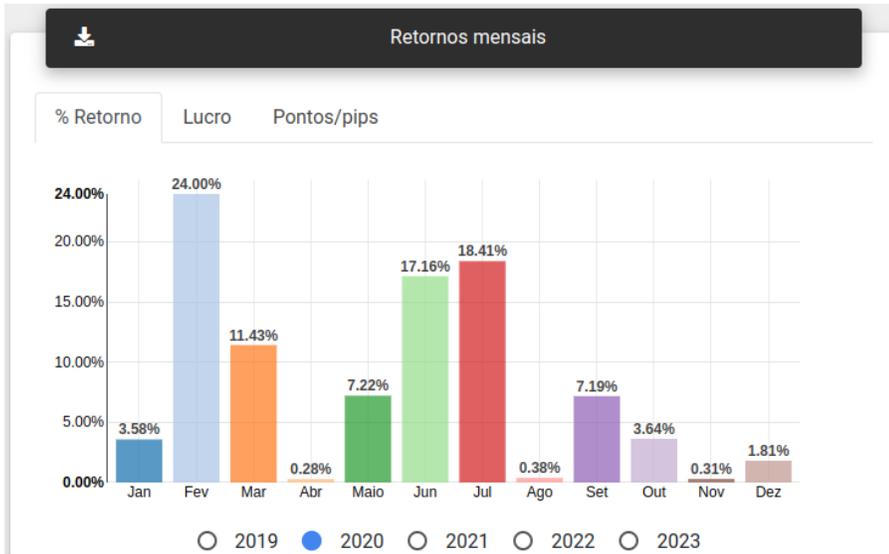
Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Estadísticas adicionales dos trades

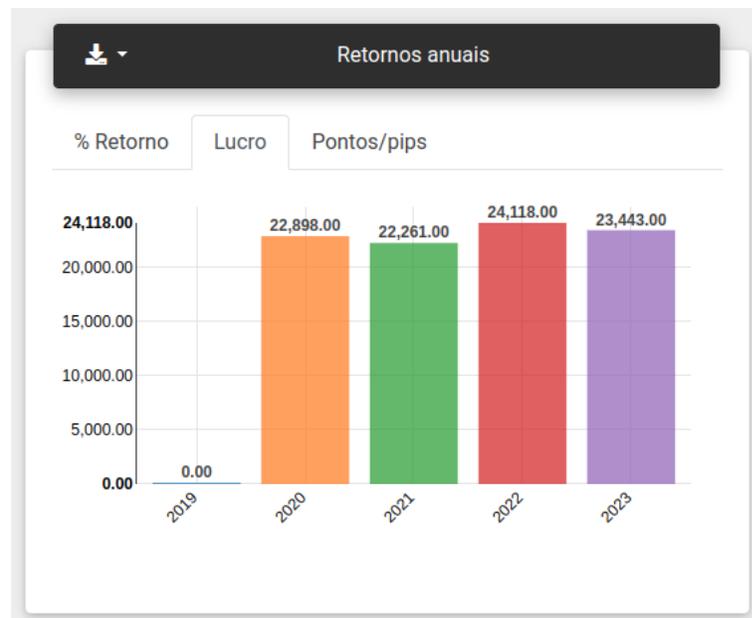
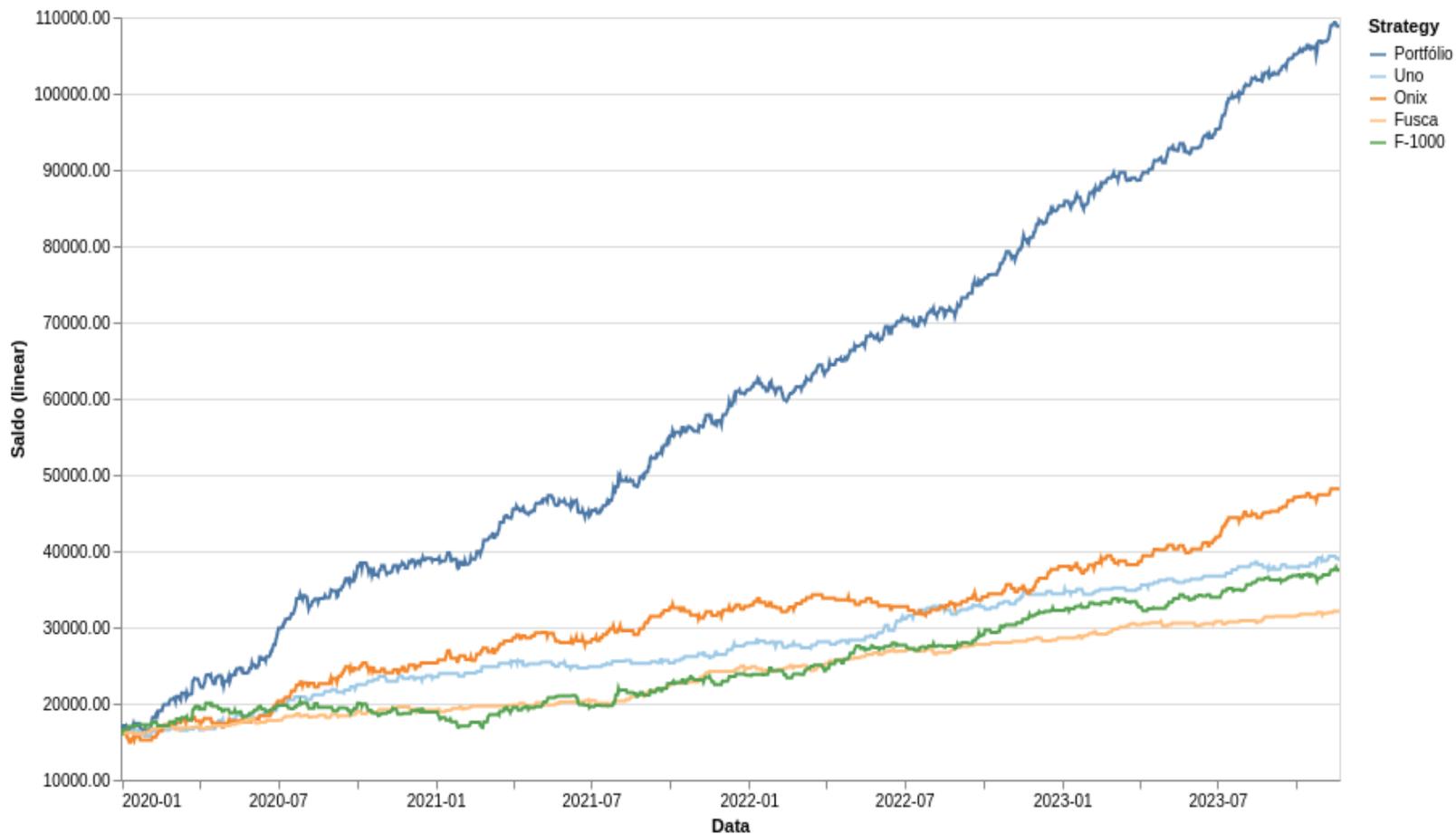
Total de operações:	1598	Trades de compra:	660	Trades de venda:	938
Z-score:	-1.92 (94.50%)	Lucro bruto:	180,517.00	Perda bruta:	-87,797.00
Dias sem trades:	644	Dias com trades:	775	Máx entradas por dia:	11
Número de dias com lucro:	1149	Número de dias com perda:	272		
Percentual de dias com lucro:	80.86%	Percentual de dias com perda:	19.14%		
Maior lucro diário:	1,674.00	Maior perda diária:	-1,130.00		
Lucro médio:	157.11	Perda média:	-322.78		
Máximo de ganhos consecutivos:	33	Máximo de perdas consecutivas:	4		
Maior lucro consecutivo:	5,543.00	Maior perda consecutiva:	-1,606.00		
Média de ganhos consecutivos:	5	Média de perdas consecutivas:	1		

Houve trades em apenas 55% dos dias. Logo, são setups que operam pouco.
São setups com alta taxa de acerto.

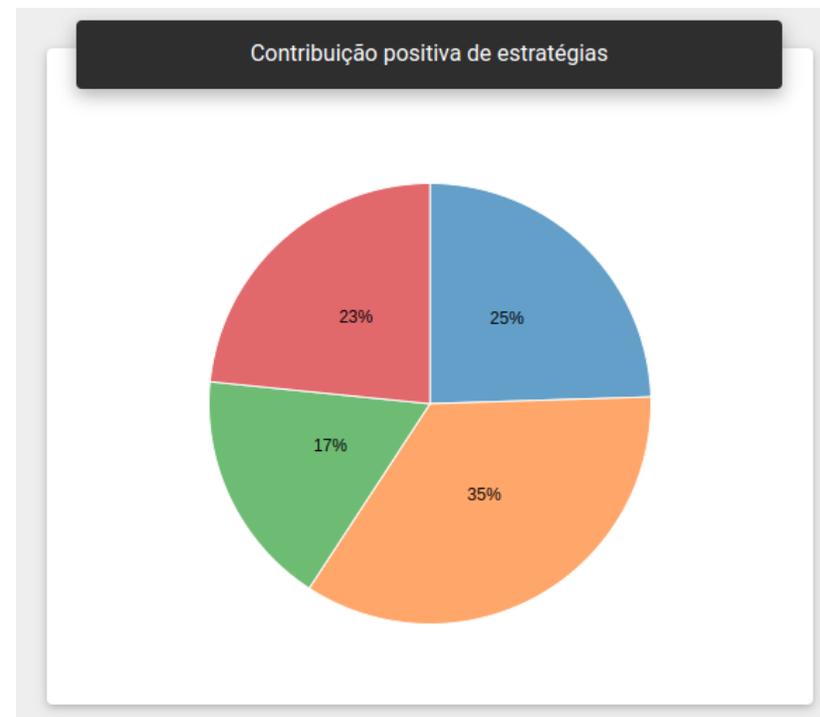
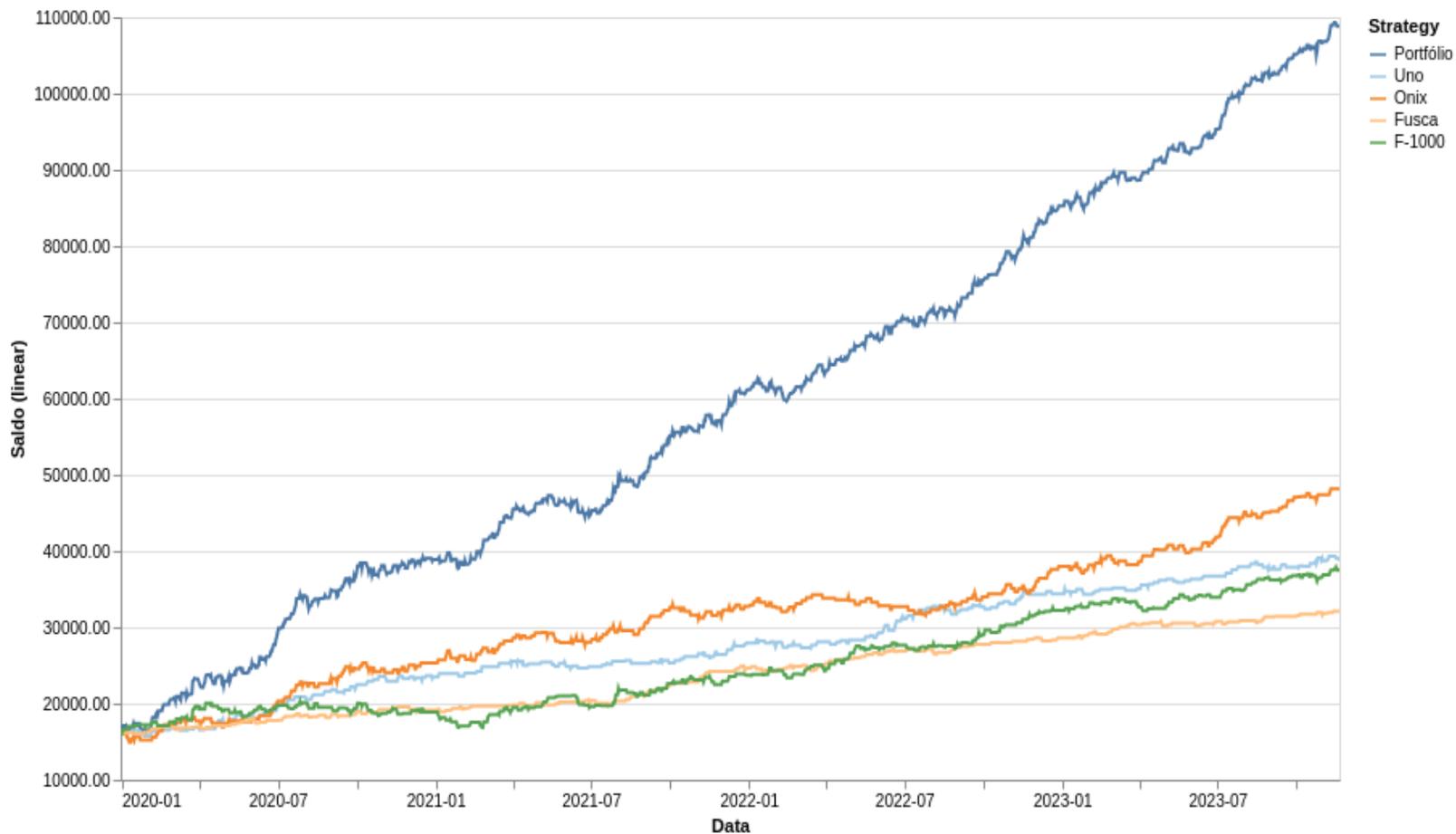
Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)



Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)



Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)



Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Contribuição individual

Show entries

Search:



ID	Nome	Gráfico	Lucro	Pontos/pips	Retorno	Drawdown	Contribuição
99999992	FM - Onix [4ctt]		32,172.00	40215.0	201.08%	-8.90%	34.70%
99999991	FM - Uno [4ctt]		22,722.00	94995.0	142.01%	-4.52%	24.51%
99999994	FM - F-1000 [4ctt]		21,700.00	68582.5	135.63%	-17.02%	23.40%
99999993	FM - Fusca [4ctt]		16,126.00	30067.5	100.79%	-3.62%	17.39%

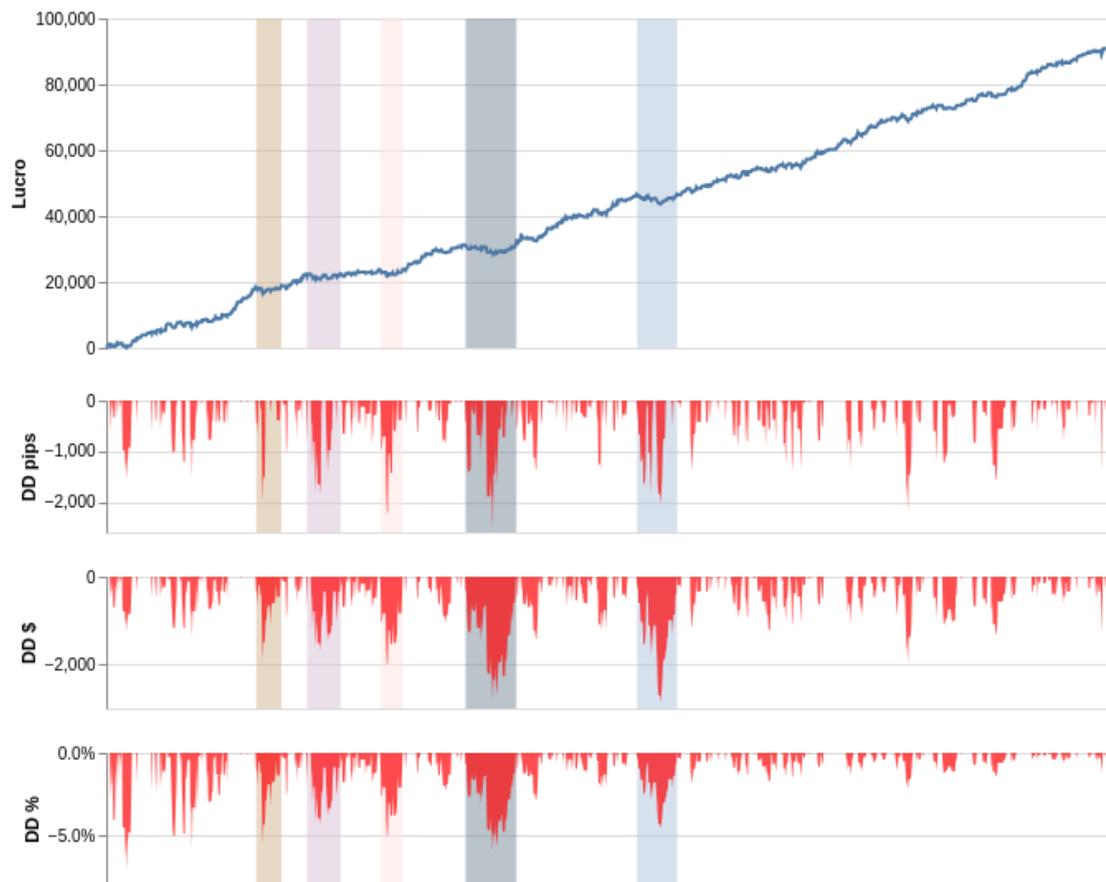
Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Estadísticas de drawdown

Máximo relativo:	-7.18% (-1,250.00)
Máximo absoluto:	-2,860.00 (-4.57%)
Sobre o saldo inicial:	-17.88% (-2,860.00)
Drawdown médio:	-1.32%
Duração máxima:	71 dias
Duração média:	8 dias
Fator de recuperação:	32.42



Drawdowns mais longos



Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Detalhes de drawdown						
Início	Fim	Duração (dias)	Drawdown (%)	Valor (\$)	Pontos/pips	
2021-05-17	2021-07-27	71	-5.94	-2,808.00	-2560	
2022-01-12	2022-03-09	56	-4.57	-2,860.00	-2048	
2020-10-07	2020-11-23	47	-4.36	-1,676.00	-1853	
2020-07-28	2020-09-01	35	-5.50	-1,890.00	-2010	
2021-01-18	2021-02-18	31	-5.11	-2,032.00	-2265	
2020-04-13	2020-05-11	28	-5.86	-1,392.00	-1535	
2022-06-30	2022-07-28	28	-1.71	-1,210.00	-910	
2020-12-18	2021-01-14	27	-1.79	-702.00	-848	
2021-08-05	2021-08-30	25	-2.85	-1,422.00	-1375	
2021-04-06	2021-04-27	21	-2.31	-1,059.00	-860	

Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

< Smarttbot - Comboio ONE - Backtest Análise de Monte Carlo

Estadísticas gerais

Número de iterações:	2000	Dias por iteração:	1349
Saldo Inicial:	16,000.00 BRL	Média saldo final:	103,971.50 BRL
Saldo mínimo alcançado:	10,798.00 BRL	Máximo drawdown do saldo inicial:	32.51%
Saldo final máximo:	109,590.04 BRL	Máximo retorno total:	584.94%

Estadísticas da distribuição

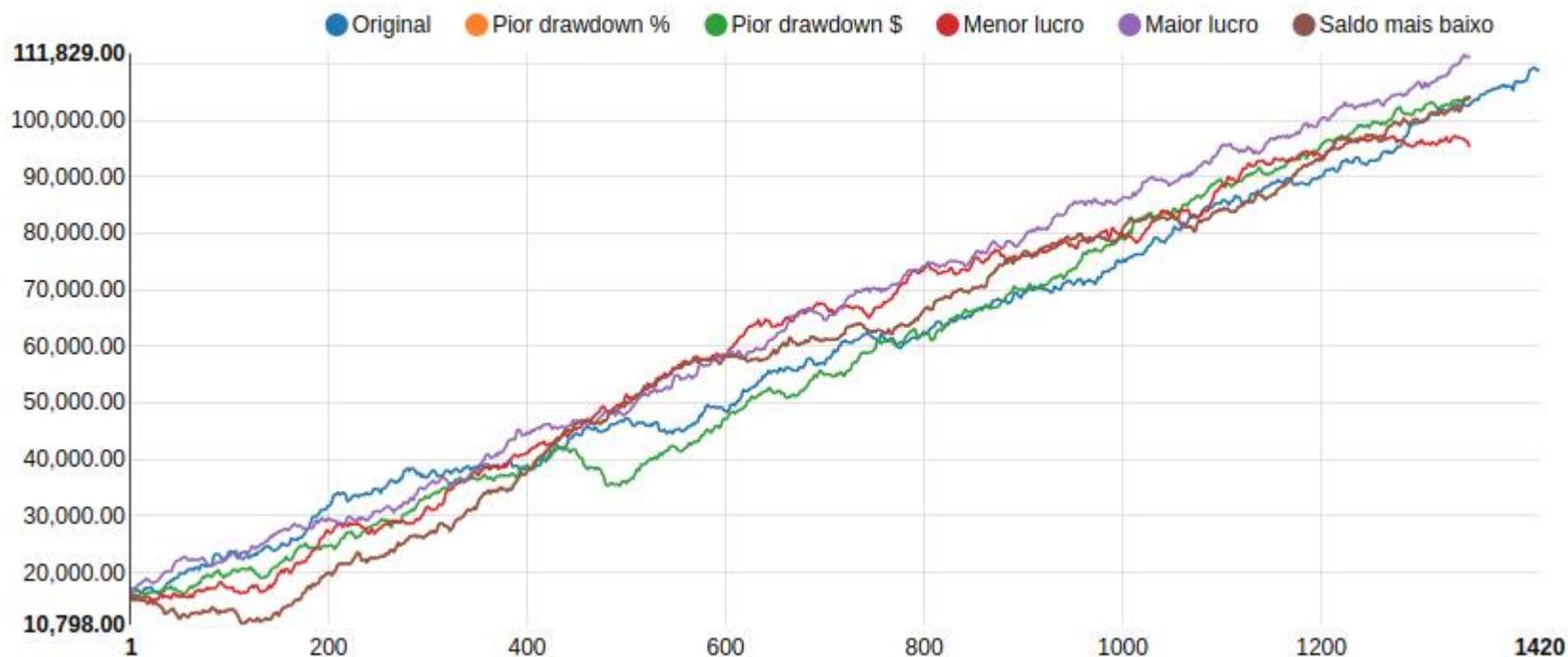
Métrica	Média	Desvio padrão	Max 95% confiança	Max 99% confiança
Drawdown (%)	9.00%	3.67%	16.87%	22.26%
Drawdown (\$)	3,079.00	777.60	4,684.20	5,601.41
Saldo final	103,971.50	2,412.89	108,039.30	109,590.04
Retorno total	549.82%	15.08%	575.25%	584.94%

Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

< ↺ Smarttbot - Comboio ONE - Backtest Análise de Monte Carlo



Principais curvas de capital



Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

< Smarttbot - Comboio ONE - Backtest - Correlação entre Estratégias ?

Estadísticas de entradas diárias

Mostrar entradas

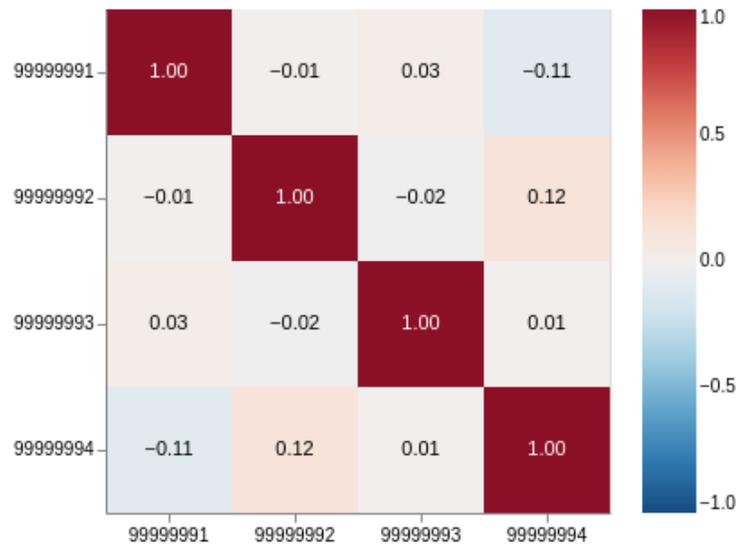
Pesquisar:

ID	Nome	Dias sem trades	Dias com trades	Máximo de entradas por dia	Média de entradas por dia
99999991	FM - Uno [4ctt]	1158	261	2	1
99999992	FM - Onix [4ctt]	1081	338	1	1
99999993	FM - Fusca [4ctt]	1185	234	4	2
99999994	FM - F-1000 [4ctt]	1002	417	8	2
Portfolio	Smarttbot - Comboio ONE - Backtest	644	775	11	2

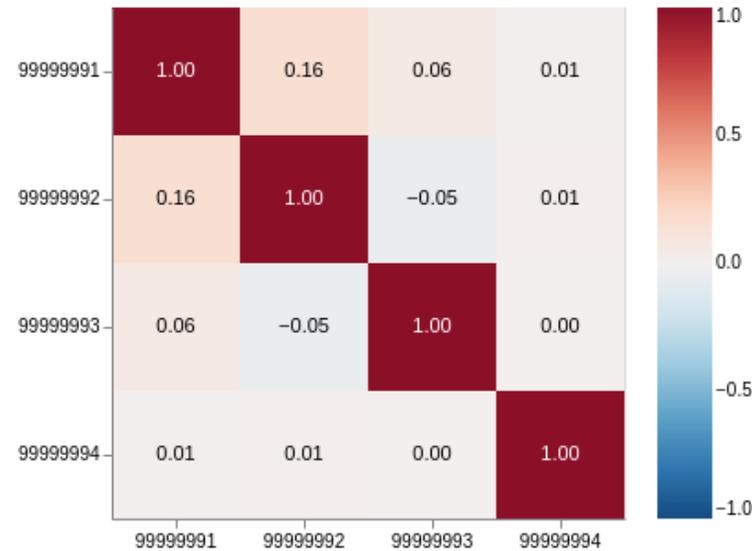
Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

< Smarttbot - Comboio ONE - Backtest - Correlação entre Estratégias ?

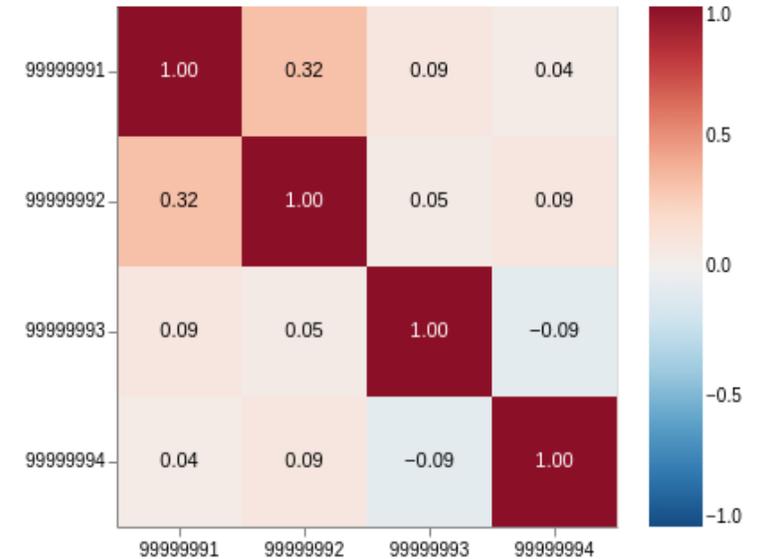
Diário



Semanal



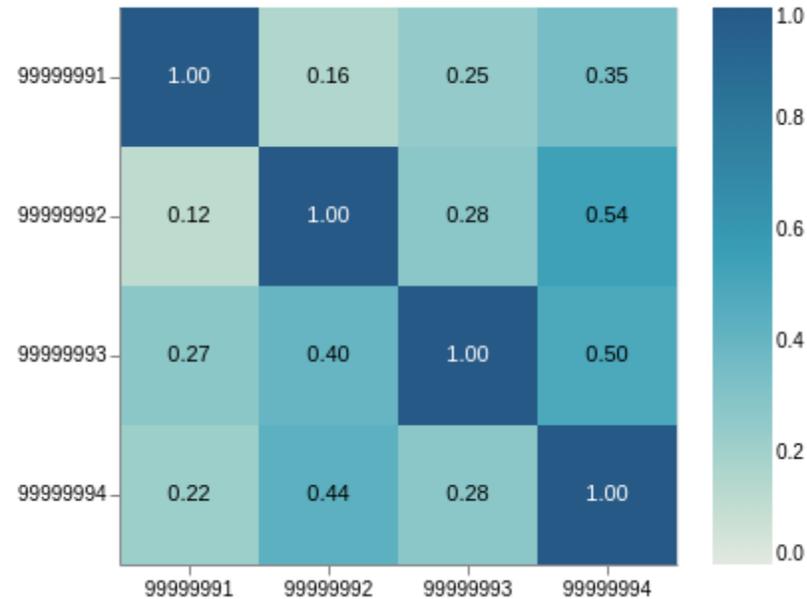
Mensal



Dados de *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

< Smarttbot - Comboio ONE - Backtest - Correlação entre Estratégias ?

Probabilidade de operações simultâneas em um mesmo dia



Dados de conta simulada. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Data da amostragem: 03 de julho de 2023 -- 28 de Novembro de 2023

Principais estatísticas

Lucro líquido: 6,184.00
Retorno total: 38.65%
Drawdown: -10.95%

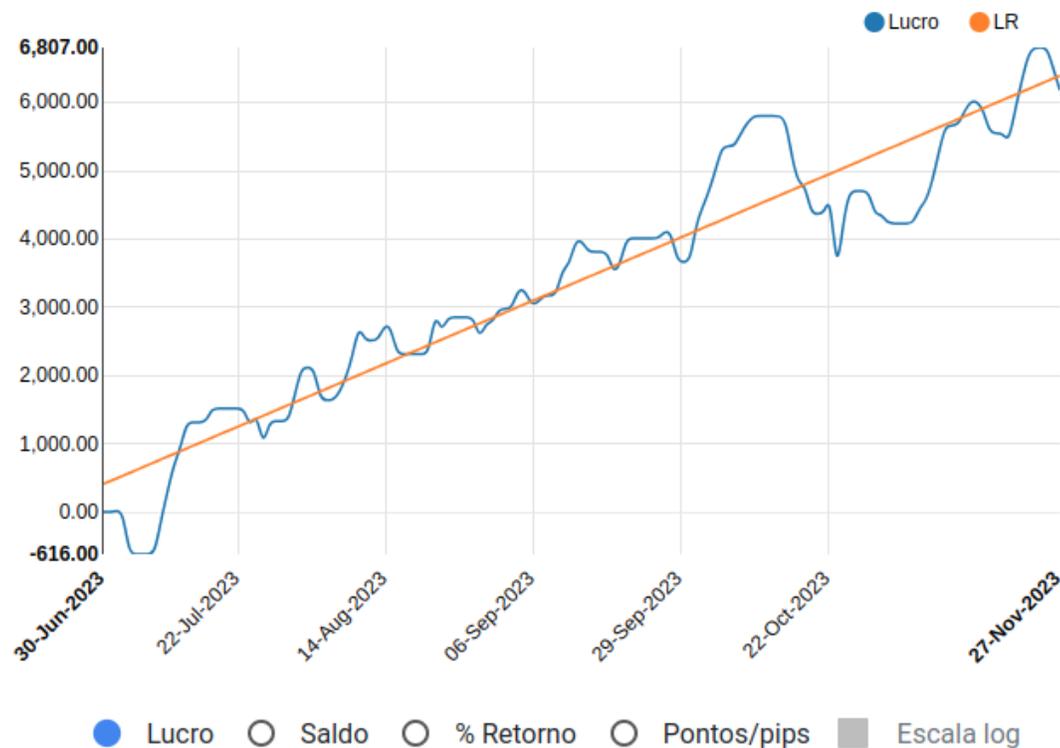
PROC: 19.13%
CAGR: 121.60%
Anual: 118.61%
Mensal: 6.75%
AHPR: 0.23%
GHPR: 0.22%

Fator de lucro: 1.70
Resultado médio: 40.95
Taxa de payout: 0.32
Sharpe ratio: 0.17
Calmar ratio: 11.11

Moeda do relatório: BRL
Histórico verificado: ✖ Não ⓘ



Curva de capital



Dados de conta simulada. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Data da amostragem: 03 de julho de 2023 -- 28 de Novembro de 2023

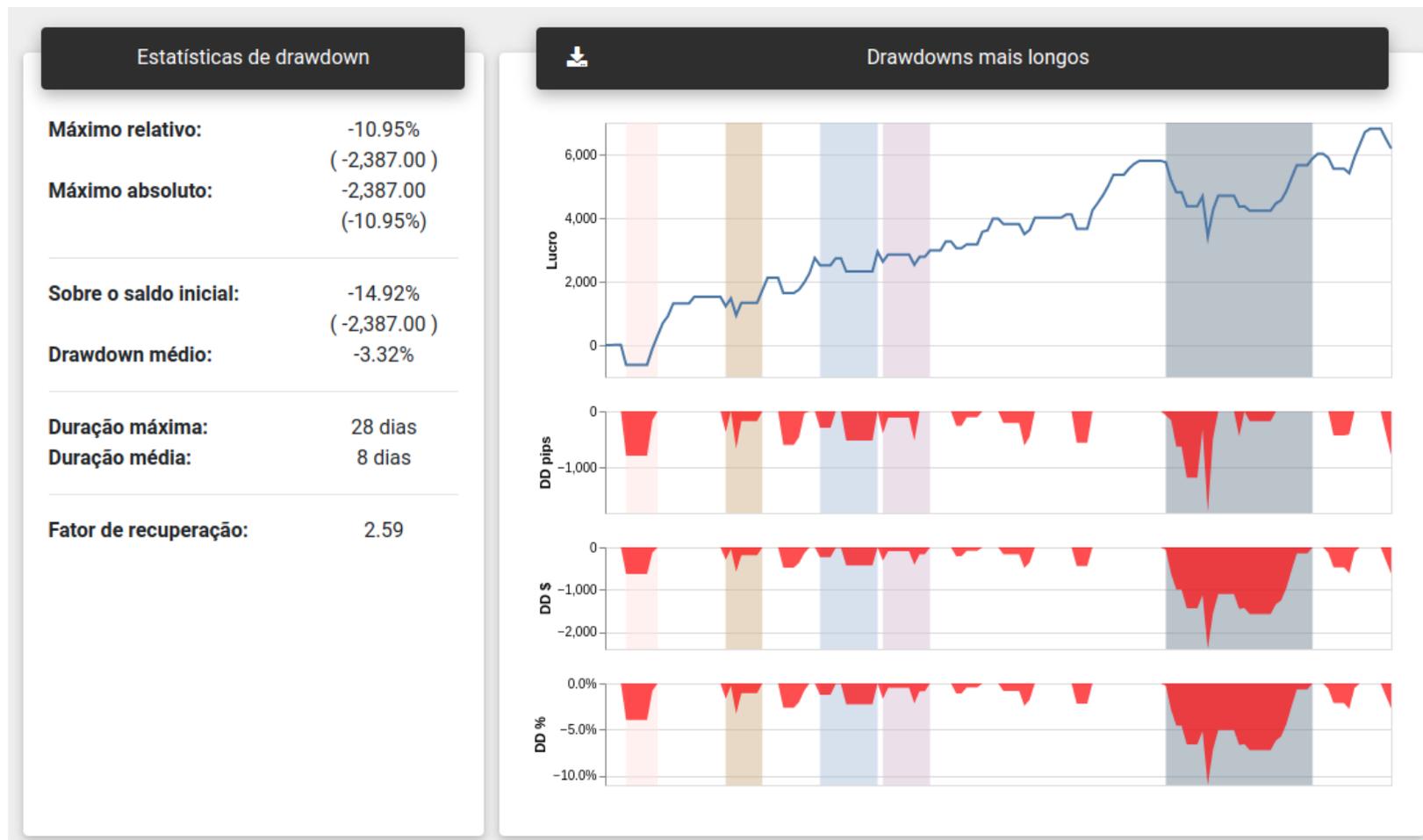
Estadísticas adicionais dos trades

Total de operações:	129	Trades de compra:	63	Trades de venda:	66
Z-score:	-0.27 (21.09%)	Lucro bruto:	14,976.00	Perda bruta:	-8,792.00
Dias sem trades:	74	Dias com trades:	75	Máx entradas por dia:	7

Número de dias com lucro:	127	Número de dias com perda:	24
Percentual de dias com lucro:	84.11%	Percentual de dias com perda:	15.89%
Maior lucro diário:	831.00	Maior perda diária:	-1,263.00
Lucro médio:	117.92	Perda média:	-366.33
Máximo de ganhos consecutivos:	18	Máximo de perdas consecutivas:	3
Maior lucro consecutivo:	2,140.00	Maior perda consecutiva:	-1,263.00
Média de ganhos consecutivos:	6	Média de perdas consecutivas:	1

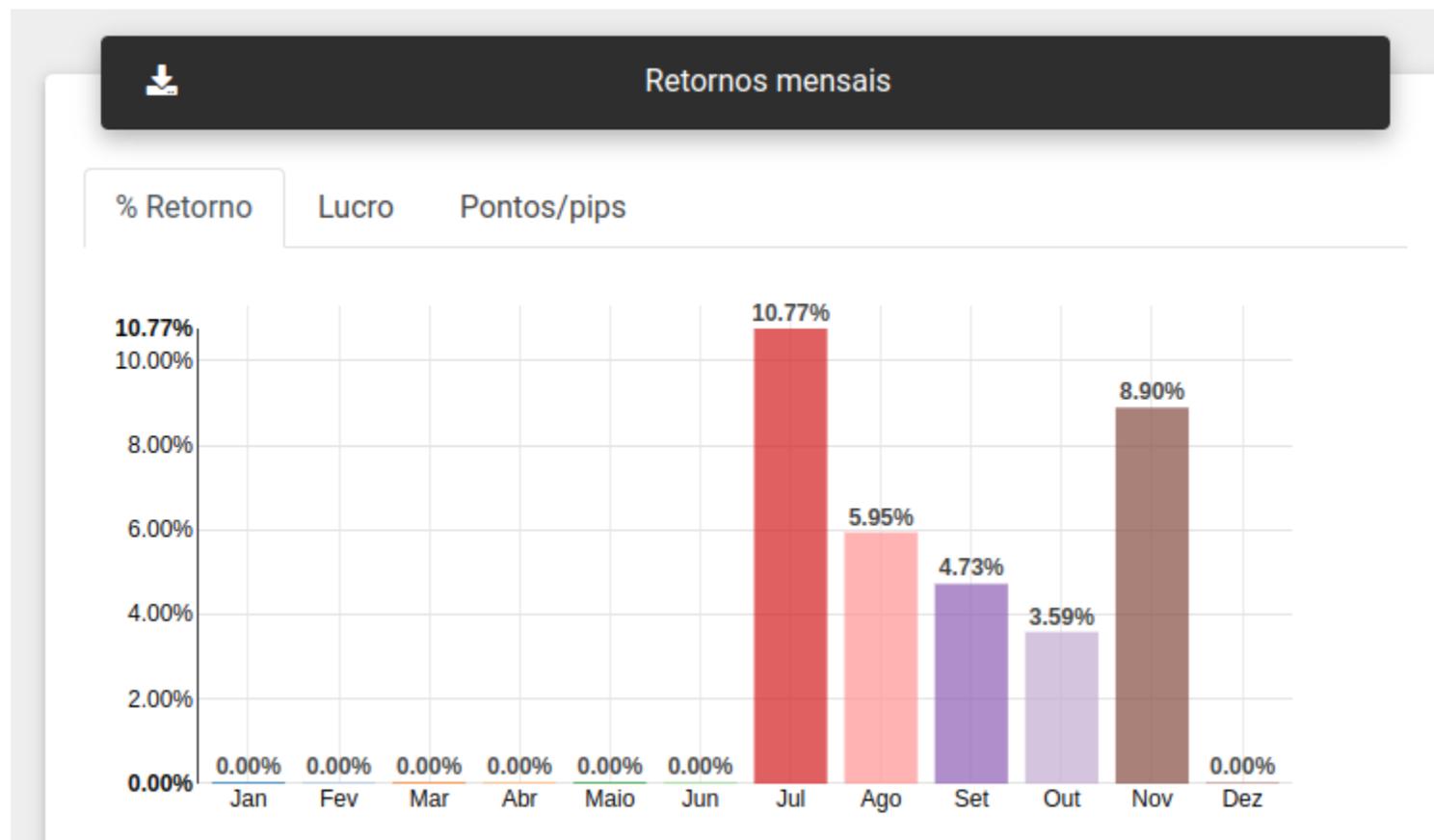
Dados de conta simulada. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Data da amostragem: 03 de julho de 2023 -- 28 de Novembro de 2023



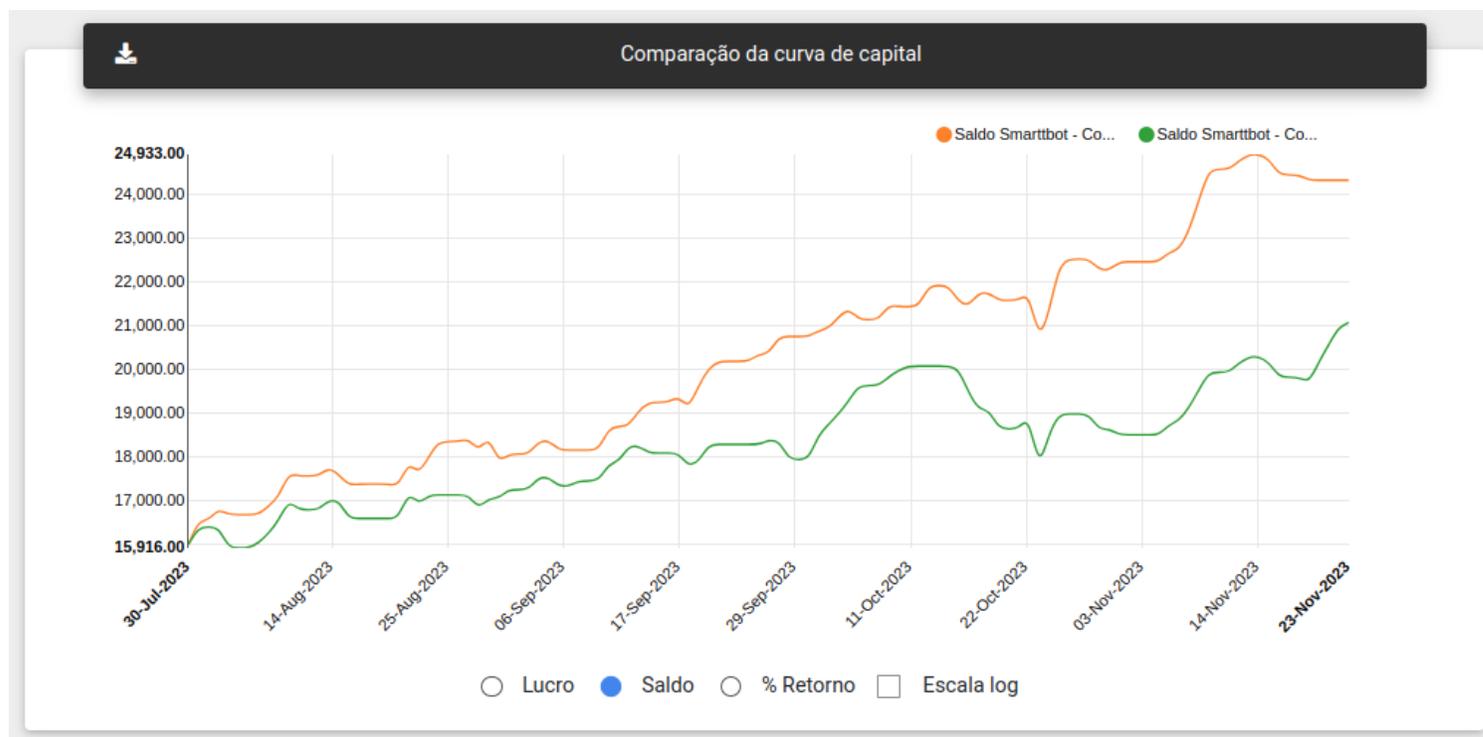
Dados de conta simulada. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Data da amostragem: 03 de julho de 2023 -- 28 de Novembro de 2023



Dados de conta simulada versus *backtest*. Capital de referência, R\$ 16 mil (R\$ 1 mil reais por contrato)

Data da amostragem: 03 de julho de 2023 -- 28 de Novembro de 2023



Essa comparação não é real, porque para backtest utilizamos as configurações atuais do setup enquanto a conta demo teve de ajustes pequenos a trocas completas de setups. Isso é comprovado quando se mostra que em alguns momentos a demo foi bem melhor (afinal, não teria ganho tanto quanto o antigo ganhou – veja início de outubro)

Data da amostragem: 03 de julho de 2023 -- 1 de Dezembro de 2023

Acesso ao sistema de assinatura e paper trade: <https://app.smarttbot.com/smarttstore/detalhes/1161>



Disclaimer:

"O investimento em renda variável pode ser altamente alavancado, apresentar alto nível de risco e pode não ser adequado para todas as pessoas. O investidor deve fazer operações neste tipo de mercado apenas se tiver experiência prévia e entender os riscos associados. Recomendamos que procure aconselhamento independente.

O conteúdo apresentado no site, documentos, informes, mídias sociais e canais de comunicação da FindMoney TM não se trata de recomendação, indicação e/ou aconselhamento de investimento, **sendo única e exclusiva responsabilidade do investidor a tomada de decisão**, apresentando apenas caráter educativo.

A FindMoney TM não recomenda ou oferece qualquer garantia sobre o futuro desempenho de qualquer sistema ou tecnologia.

O investidor deve consultar seu próprio assessor ou conselheiro jurídico, tributário, regulatório, técnico, de negócios, de investimentos, financeiro e contábil, na medida em que julgar necessário, para assessoria na escolha e definição de softwares, plataformas, robôs, algoritmos, estratégias e setups."