

Relatório de Desempenho

Portfólio Sevilha

13/03/2026 13:21:00

Performance

Gerado em 13/03/2026 13:21:00



Início: 01/01/2022 Fim: 13/03/2026

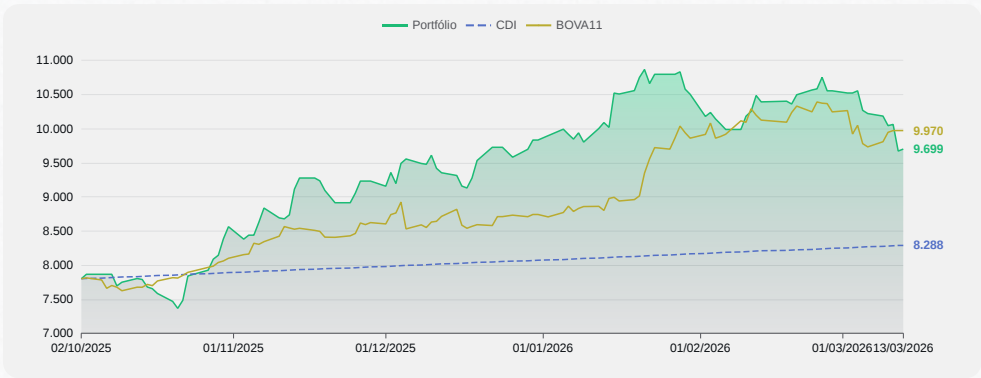
Estratégia

O Portfólio Sevilha é um produto algorítmico desenhado especificamente para atuar como um rastreador de tendências (trend-following) e capturador de grandes assimetrias de mercado. Diferente de estratégias de alta frequência, este sistema ignora as flutuações menores e os ruídos de curto prazo do mini-índice para focar no timing preciso de grandes rompimentos e movimentos direcionais, seja de alta ou de baixa. O seu modelo matemático busca identificar a entrada de fluxo institucional e o ganho de tração no mercado, alongando os alvos para maximizar a pontuação em operações prolongadas. O Sevilha é o produto ideal para atuar como o principal gerador de performance expressiva, entregando um payoff altamente positivo e compensando rebaixamentos ao surfar os dias de forte direcionalidade.

Descrição

O Portfólio Sevilha é um produto algorítmico desenhado especificamente para atuar como um rastreador de tendências (trend-following) e capturador de grandes assimetrias de mercado. Diferente de estratégias de alta frequência, este sistema ignora as flutuações menores e os ruídos de curto prazo do mini-índice para focar no timing preciso de grandes rompimentos e movimentos direcionais, seja de alta ou de baixa. O seu modelo matemático busca identificar a entrada de fluxo institucional e o ganho de tração no mercado, alongando os alvos para maximizar a pontuação em operações prolongadas. O Sevilha é o produto ideal para atuar como o principal gerador de performance expressiva, entregando um payoff altamente positivo e compensando rebaixamentos ao surfar os dias de forte direcionalidade.

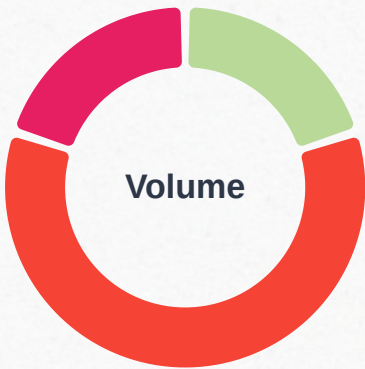
Curva de capital (paper trade)



Resumo (paper trade)

Qtd. operações	233
Méd. de operações	2.45
Volume total	5
Estilo	DAY TRADE
Perda máx. diária	-R\$ 680,00
Capital mínimo	R\$ 7.800,00
Data de início	02/10/2025

Composição



- E1 EST 20% • WDOFUT
- E2 EST 60% • WINFUT
- E3 EST 20% • WINFUT

Ativos operados:

WDOFUT WINFUT

Tags:

Desempenho anual (R\$)

Backtest Paper Trade

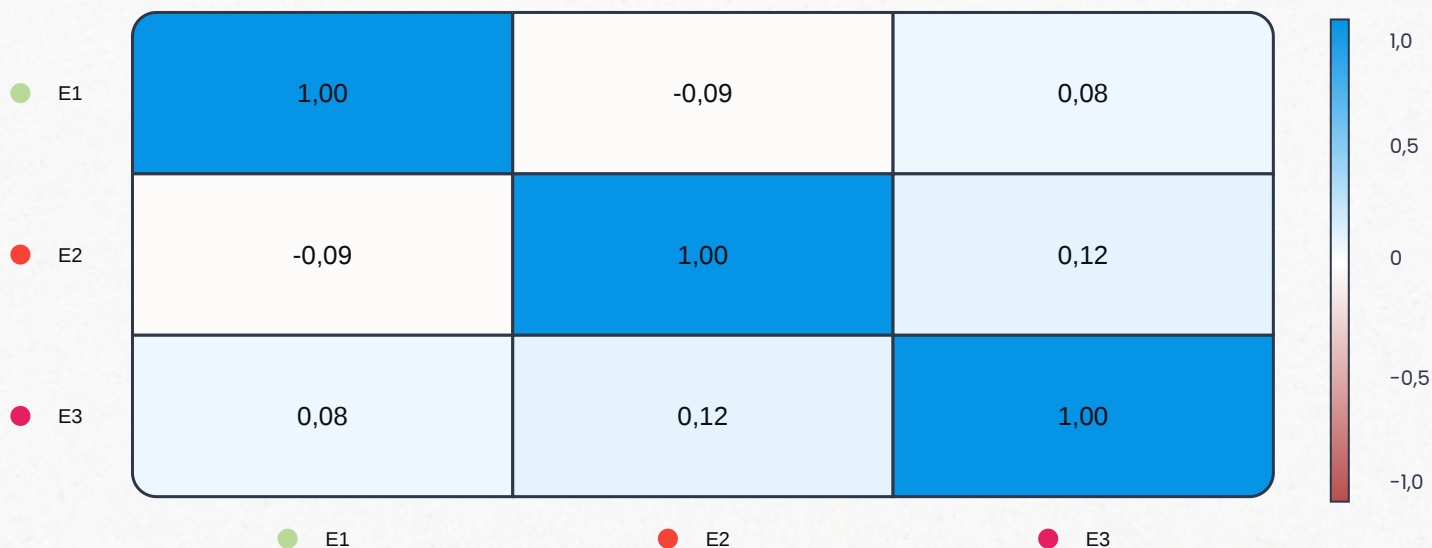
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	63,00	1.028,00	2.000,00	1.263,00	42,00	419,00	-1.148,00	762,00	668,00	601,00	5.698,00
2026	670,00	51,00	-853,00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-132,00

Estatísticas gerais (paper trade)

+24.35% Resultado Bruto %	+R\$ 1.899,00 Resultado Bruto	+R\$ 6.880,00 Lucro Bruto	-R\$ 4.981,00 Perda Bruta	62,66% Taxa de Acerto
233 Operações	146 Operações com Ganho	87 Operações com Perda	670 Volume Total Operado	-10.99% Drawdown (Capital Acumulado)
+R\$ 134,90 Ganho Médio Diário	-R\$ 113,20 Perda Média Diária	-R\$ 680,00 Perda Máxima Diária	53,68% Taxa de Acerto Diária	-15.31% Drawdown (Capital Recomendado)
118 Operações de Compra	115 Operações de Venda	1,38X Fator de Lucro	51 Dias com Ganho	44 Dias com Perda
1:0.73 RRR* Planejada	1:0.42 RRR* Executada			

* Relação Risco Retorno

Matriz de correlação



Últimas operações

Operação	Volume	Entrada	Saída	Resultado
  WINFUT	1	180580 13/03/2026 12:26:17	180760 13/03/2026 12:35:52	▼ -R\$ 36,00 (-0,46%)
  WDOFUT	1	5285 13/03/2026 12:20:14	5291.5 13/03/2026 12:23:36	▲ R\$ 65,00 (0,83%)
  WINFUT	1	180855 12/03/2026 12:17:55	181255 12/03/2026 12:27:55	▼ -R\$ 80,00 (-1,03%)
  WDOFUT	1	5182.5 12/03/2026 10:05:39	5189.5 12/03/2026 10:11:42	▼ -R\$ 70,00 (-0,90%)
  WINFUT	3	183535 12/03/2026 09:15:00	183935 12/03/2026 09:27:13	▼ -R\$ 240,00 (-3,08%)
  WINFUT	1	185025 11/03/2026 14:41:35	185495 11/03/2026 14:50:58	▼ -R\$ 94,00 (-1,21%)
  WINFUT	1	186365 11/03/2026 12:21:17	186205 11/03/2026 12:30:22	▲ R\$ 32,00 (0,41%)
  WDOFUT	1	5189.5 11/03/2026 10:39:17	5182.5 11/03/2026 10:58:58	▲ R\$ 70,00 (0,90%)
  WDOFUT	1	5188.5 11/03/2026 10:34:23	5195 11/03/2026 10:36:51	▼ -R\$ 65,00 (-0,83%)
  WDOFUT	1	5193 11/03/2026 09:33:46	5200.5 11/03/2026 09:38:37	▲ R\$ 75,00 (0,96%)
  WDOFUT	1	5194.5 10/03/2026 09:46:49	5201 10/03/2026 09:58:34	▼ -R\$ 65,00 (-0,83%)
  WDOFUT	1	5194 10/03/2026 09:22:02	5201.5 10/03/2026 09:26:47	▼ -R\$ 75,00 (-0,96%)
  WINFUT	1	181810 09/03/2026 13:56:17	181670 09/03/2026 14:15:58	▲ R\$ 28,00 (0,36%)
  WDOFUT	1	5288.5 09/03/2026 09:37:56	5282.5 09/03/2026 09:41:16	▼ -R\$ 60,00 (-0,77%)
  WDOFUT	1	5288.5 09/03/2026 09:28:35	5282 09/03/2026 09:29:56	▲ R\$ 65,00 (0,83%)
  WDOFUT	1	5287.5 09/03/2026 09:18:01	5294.5 09/03/2026 09:19:32	▼ -R\$ 70,00 (-0,90%)
  WINFUT	1	181885 06/03/2026 14:44:18	181735 06/03/2026 14:45:24	▲ R\$ 30,00 (0,38%)
  WINFUT	1	182230 06/03/2026 12:26:17	182370 06/03/2026 12:29:53	▲ R\$ 28,00 (0,36%)
  WDOFUT	1	5301.5 06/03/2026 10:35:19	5309 06/03/2026 10:37:10	▼ -R\$ 75,00 (-0,96%)
  WDOFUT	1	5305 06/03/2026 10:30:37	5308 06/03/2026 10:31:53	▼ -R\$ 30,00 (-0,38%)

Retorno sobre capital recomendado (%)

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	0,81	13,18	25,64	16,19	0,54	5,37	-14,72	9,77	8,56	7,71	73,05
2026	8,59	0,65	-10,94	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,69

Número de operações

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	43	30	52	125
2026	52	31	25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	108

Retorno em pontos

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.810,00	3.340,00	3.005,00	10.155,00
2026	3.350,00	255,00	-4.265,00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-660,00

Volume operado

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	146	90	150	386
2026	152	74	58	-	-	-	-	-	-	-	-	-	284



Desenvolvedor

OnTick

Disclaimer

Investimentos e estratégias de investimento apresentam riscos potenciais e retornos. Desempenhos passados não são indicativos de resultados futuros. Nós não garantimos qualquer resultado específico ou lucro. Você deve estar ciente dos riscos e estar disposto a aceitá-los para investir nos mercados. Qualquer decisão de investimento que você tome deve ser baseada em sua própria diligência e consideração de suas circunstâncias pessoais, incluindo, mas não se limitando a, sua tolerância ao risco, situação financeira e objetivos de investimento. Nós não nos responsabilizamos por quaisquer perdas que você possa sofrer como resultado do uso das informações, dados ou serviços da plataforma. Ao utilizar nosso site e nossos serviços, você concorda com este aviso de isenção de responsabilidade e assume total responsabilidade por suas decisões e ações.

Declaramos que a estratégia presente nesta lâmina reflete única e exclusivamente as opiniões pessoais do analista responsável, elaborada de forma independente, sem influência de terceiros. Informamos também que não há situações que afetem a imparcialidade desta lâmina descritiva de estratégia ou configurem conflito de interesses. Além disso, declaramos, como pessoa jurídica, que todas as situações que possam afetar a imparcialidade desta lâmina ou que configurem ou possam configurar conflito de interesses são devidamente destacadas em nossos relatórios de análise, em conformidade com as declarações previstas nos artigos 21 e 22 da Resolução CVM nº 20/2021.