

Relatório de Desempenho

Portfólio Frankfurt

16/03/2026 09:27:10

Performance

Gerado em 16/03/2026 09:27:10



Analista: OnTick

Início: 01/01/2022 Fim: 16/03/2026

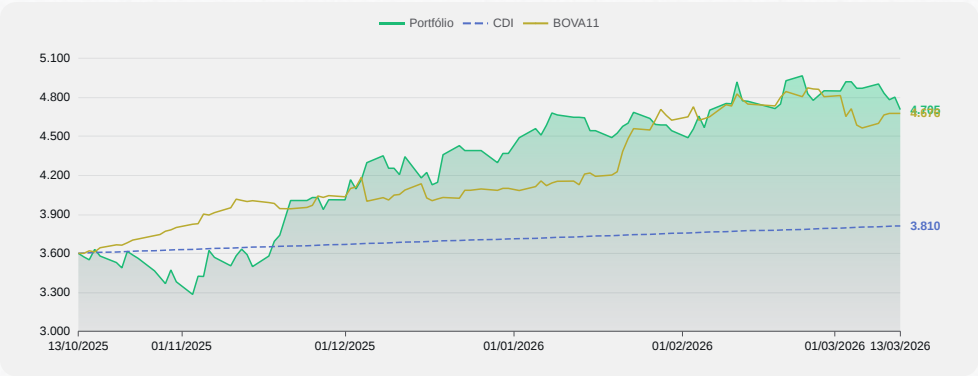
Estratégia

O Portfólio Frankfurt é o produto quantitativo voltado para a estabilidade matemática, a defesa do patrimônio e o controle rigoroso de risco. Estruturado sob uma lógica de reversão à média e identificação de níveis institucionais de suporte e resistência, este sistema opera de forma contrária aos excessos de euforia ou pânico no WINFUT. Atuando com filtros algorítmicos conservadores, o Frankfurt possui uma seletividade maior em suas entradas, buscando operar apenas em pontos de exaustão extrema de preço. O resultado é um sistema focado em manter uma alta taxa de acerto e stops curtos e bem definidos. É a solução perfeita para ancorar a exposição ao risco e garantir um crescimento mais suave da curva de capital, protegendo o saldo contra sobressaltos violentos do mercado.

Descrição

O Portfólio Frankfurt é o produto quantitativo voltado para a estabilidade matemática, a defesa do patrimônio e o controle rigoroso de risco. Estruturado sob uma lógica de reversão à média e identificação de níveis institucionais de suporte e resistência, este sistema opera de forma contrária aos excessos de euforia ou pânico no WINFUT. Atuando com filtros algorítmicos conservadores, o Frankfurt possui uma seletividade maior em suas entradas, buscando operar apenas em pontos de exaustão extrema de preço. O resultado é um sistema focado em manter uma alta taxa de acerto e stops curtos e bem definidos. É a solução perfeita para ancorar a exposição ao risco e garantir um crescimento mais suave da curva de capital, protegendo o saldo contra sobressaltos violentos do mercado.

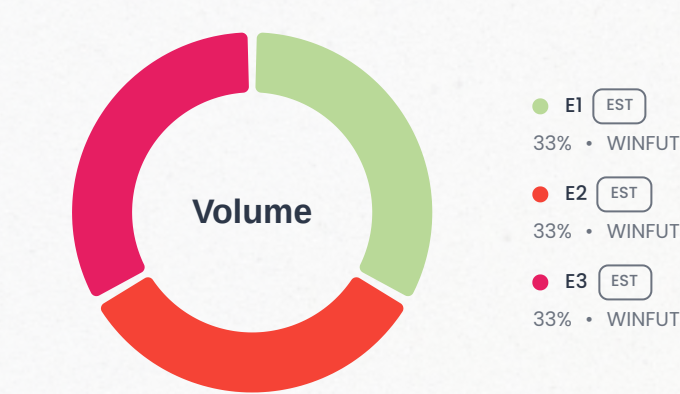
Curva de capital (paper trade)



Resumo (paper trade)

Qtd. operações	203
Méd. de operações	2.16
Volume total	3
Estilo	DAY TRADE
Perda máx. diária	-R\$ 300,00
Capital mínimo	R\$ 3.600,00
Data de início	14/10/2025

Composição



Ativos operados:

WINFUT

Tags:

Desempenho anual (R\$)

☒ Backtest ☐ Paper Trade

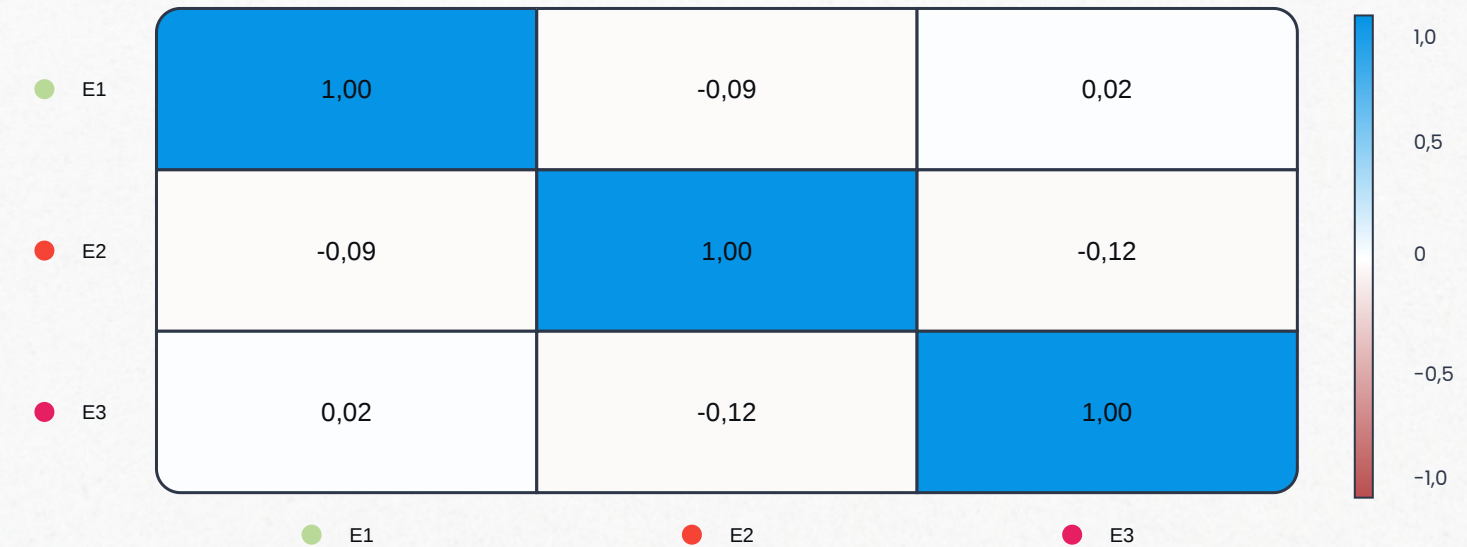
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-47,00	629,00	-298,00	247,00	-161,00	588,00	247,00	56,00	-219,00	631,00	356,00	2.029,00
2026	175,00	307,00	-145,00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	337,00

Estatísticas gerais (paper trade)

+30.69% Resultado Bruto %	+R\$ 1.105,00 Resultado Bruto	+R\$ 3.872,00 Lucro Bruto	-R\$ 2.767,00 Perda Bruta	35,47% Taxa de Acerto
203 Operações	72 Operações com Ganho	131 Operações com Perda	406 Volume Total Operado	-9.53% Drawdown (Capital Acumulado)
+R\$ 86,04 Ganho Médio Diário	-R\$ 56,47 Perda Média Diária	-R\$ 300,00 Perda Máxima Diária	47,87% Taxa de Acerto Diária	-9.61% Drawdown (Capital Recomendado)
120 Operações de Compra	83 Operações de Venda	1,40X Fator de Lucro	45 Dias com Ganho	49 Dias com Perda
1:2.22 RRR* Planejada	1:2.07 RRR* Executada			

* Relação Risco Retorno

Matriz de correlação



Últimas operações

Operação	Volume	Entrada	Saída	Resultado
  WINFUT	1	180495 13/03/2026 15:05:31	180720 13/03/2026 15:39:17	▼ -R\$ 45,00 (-1,25%)
  WINFUT	1	179940 13/03/2026 14:53:30	180190 13/03/2026 14:56:16	▼ -R\$ 50,00 (-1,39%)
  WINFUT	1	182040 13/03/2026 11:24:12	182045 13/03/2026 11:31:21	▼ -R\$ 1,00 (-0,03%)
  WINFUT	1	181985 12/03/2026 14:24:03	181735 12/03/2026 14:28:20	▼ -R\$ 50,00 (-1,39%)
  WINFUT	1	183290 12/03/2026 10:18:04	182940 12/03/2026 10:19:25	▲ R\$ 70,00 (1,94%)
  WINFUT	1	185040 11/03/2026 15:12:18	185295 11/03/2026 15:14:00	▼ -R\$ 51,00 (-1,42%)
  WINFUT	1	187700 10/03/2026 14:30:55	187435 10/03/2026 14:33:51	▼ -R\$ 53,00 (-1,47%)
  WINFUT	1	184585 10/03/2026 11:36:21	184950 10/03/2026 11:41:28	▲ R\$ 73,00 (2,03%)
  WINFUT	1	183945 10/03/2026 11:24:27	184170 10/03/2026 11:28:40	▼ -R\$ 45,00 (-1,25%)
  WINFUT	1	183695 10/03/2026 10:12:02	183470 10/03/2026 10:16:15	▼ -R\$ 45,00 (-1,25%)
  WINFUT	1	182080 09/03/2026 13:42:49	181425 09/03/2026 14:22:07	▲ R\$ 131,00 (3,64%)
  WINFUT	1	180685 09/03/2026 11:28:03	180915 09/03/2026 11:32:00	▼ -R\$ 46,00 (-1,28%)
  WINFUT	1	180070 09/03/2026 11:12:01	180330 09/03/2026 11:14:06	▼ -R\$ 52,00 (-1,44%)
  WINFUT	1	182855 05/03/2026 15:31:09	183105 05/03/2026 15:35:25	▼ -R\$ 50,00 (-1,39%)
  WINFUT	1	187980 04/03/2026 15:51:55	188465 04/03/2026 16:43:27	▲ R\$ 97,00 (2,69%)
  WINFUT	1	186835 04/03/2026 13:32:32	187070 04/03/2026 13:46:30	▼ -R\$ 47,00 (-1,31%)
  WINFUT	1	186575 04/03/2026 13:24:17	186825 04/03/2026 13:26:23	▼ -R\$ 50,00 (-1,39%)
  WINFUT	1	184845 03/03/2026 13:12:34	185200 03/03/2026 13:17:29	▲ R\$ 71,00 (1,97%)
  WINFUT	1	191610 02/03/2026 13:42:05	191600 02/03/2026 13:51:07	▼ -R\$ 2,00 (-0,06%)
  WINFUT	1	193095 27/02/2026 12:25:23	192870 27/02/2026 13:55:32	▼ -R\$ 45,00 (-1,25%)

Retorno sobre capital recomendado (%)

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-1,31	17,47	-8,28	6,86	-4,47	16,33	6,86	1,56	-6,08	17,53	9,89	56,36
2026	4,86	8,53	-4,03	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9,36

Número de operações

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	28	42	42	112
2026	33	39	19	-	-	-	-	-	-	-	-	-	91

Retorno em pontos

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1.095,00	3.155,00	1.780,00	3.840,00
2026	875,00	1.535,00	-725,00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.685,00

Volume operado

☒ Backtest ☐ Paper Trade

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL
2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	56	84	84	224
2026	66	78	38	-	-	-	-	-	-	-	-	-	182



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.