

PORTFÓLIO QUANTITATIVO · MINI ÍNDICE B3

Quant Element

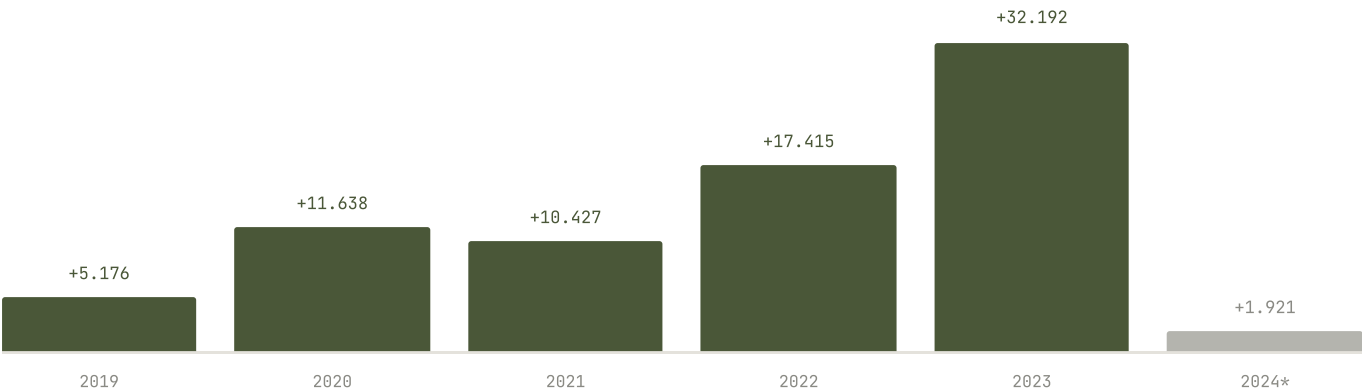
Relatório de construção e validação estatística. Seis anos de dados do Mini Índice, 3.850 operações testadas antes de qualquer capital real entrar em mercado.

LUCRO TOTAL NO PERÍODO R\$ 78.769 por contrato · 6 anos	ÍNDICE DE SHARPE 2,83 retorno ajustado ao risco	RETORNO / DRAWDOWN 22,3× lucro 22× maior que a pior queda
OPERAÇÕES REALIZADAS 3.850 48,9% de acerto · payout 1,37	DRAWDOWN MÁXIMO R\$ 3.530 17,79% · risco contido e mensurável	MÉDIA MENSAL R\$ 1.312 por contrato, todos os cenários

Seis anos, seis fechamentos positivos.

Inclui 2020 (pandemia) e 2022 (ciclo de juros em alta). Nenhum ano fechou negativo — o que sustenta a tese de que a vantagem vem da regra, não do cenário.

RESULTADO ANUAL — R\$ POR CONTRATO



* 2024: janeiro a março, período parcial anterior ao início das operações reais.

ANO	RESULTADO (R\$)	PARTICIPAÇÃO NO TOTAL
2019	+R\$ 5.176	6,6%
2020	+R\$ 11.638	14,8%
2021	+R\$ 10.427	13,2%
2022	+R\$ 17.415	22,1%
2023	+R\$ 32.192	40,9%
2024 (jan-mar)	+R\$ 1.921	2,4%
Total · 6 anos	+R\$ 78.769	100%

O QUE ESSES NÚMEROS DIZEM

Consistência, não sorte. Todos os seis anos fecharam positivos, incluindo 2020 e 2022 — dois dos ambientes mais hostis da década para o índice.

Estatística robusta. 3.850 operações eliminam o acaso. A vantagem média é de R\$ 20,46 por trade.

Acerto de 48,87% com payout 1,37. A estratégia erra mais do que acerta e ainda assim é lucrativa: ganha mais quando acerta do que perde quando erra. É assimetria, não adivinhação.

Risco controlado. Maior perda individual de R\$ 554 contra maior ganho de R\$ 842. Nenhuma operação isolada compromete o capital.

Visão de longo prazo. Meses negativos existem e são esperados; o resultado se constrói na disciplina de anos, não de dias.

Retorno/drawdown de 22,31x. Para cada real da pior queda, a estratégia produziu vinte e dois no período — a medida que separa risco calculado de aposta.

Todos os números do backtest.

Nada resumido, nada escondido. São os mesmos dados que usamos internamente para decidir se uma estratégia vai a mercado.

RESULTADO

LUCRO TOTAL R\$ 78.769	LUCRO BRUTO R\$ 332.778	PERDA BRUTA R\$ 254.009
MÉDIA ANUAL R\$ 15.753	MÉDIA MENSAL R\$ 1.312	MÉDIA DIÁRIA R\$ 43,11
RETORNO MÉDIO ANUAL 157,54%	CAGR 54,76%	RESULTADO EM TICKS 37.011

RISCO

DRAWDOWN MÁXIMO R\$ 3.530	DRAWDOWN % 17,79%	RETORNO / DRAWDOWN 22,31×
ÍNDICE DE SHARPE 2,83	FATOR DE LUCRO 1,31	SQN SCORE 8,79
ESTAGNAÇÃO MÁXIMA 125 dias	ESTAGNAÇÃO % 6,86%	EXPOSIÇÃO 0%

OPERAÇÕES

TOTAL DE OPERAÇÕES 3.850	VENCEDORAS 1.876	PERDEDORAS 1.963
TAXA DE ACERTO 48,87%	PAYOUT (GANHO/PERDA) 1,37	EXPECTATIVA POR TRADE R\$ 20,46
GANHO MÉDIO R\$ 177,39	PERDA MÉDIA R\$ 129,40	MAIOR GANHO R\$ 842
MAIOR PERDA R\$ 554	MÁX. GANHOS SEGUIDOS 14	MÁX. PERDAS SEGUIDAS 17