

Projeto GO! FUSION

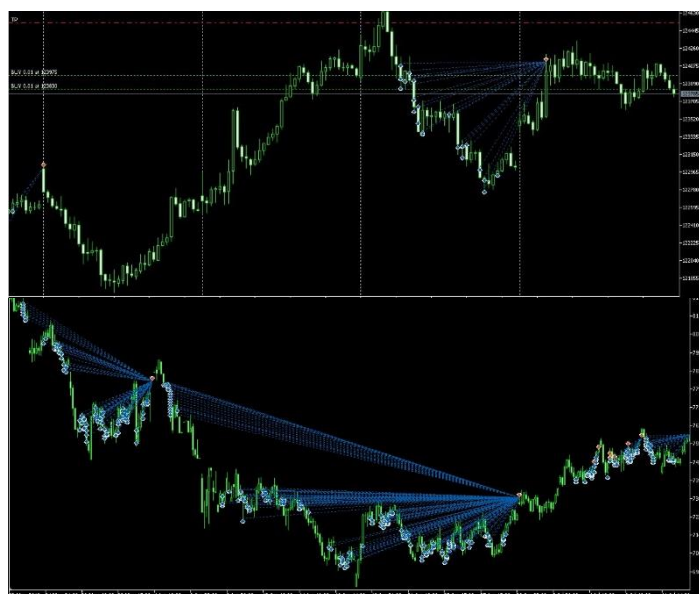
A Go! Fusion é uma estratégia feita para negociar e investir no índice brasileiro e que tem como base alguns princípios fundamentais: o fato de o mercado brasileiro, sendo pertencente a uma das principais potências econômicas mundiais, estar descontado e, também, o princípio inflacionário histórico das bolsas mundiais. Go! Fusion atua, portanto, majoritariamente em operações de compra.

Só uma retração ou estagnação do crescimento populacional poderia comprometer esses princípios, pois impactariam na cadeia de produção global e, conseqüentemente, nos mercados.

O ingresso nas posições pode ocorrer tanto a favor como contra a tendência. O gerenciamento de capital para essa estratégia deve ser feito de acordo com o capital mínimo recomendado para a exposição mínima de lotes. Não possui stop loss. A estratégia tem 4 módulos para atuar em posições compradoras e vendedoras, além de um dos módulos, Go! Fusion Light, ser uma opção para uma atuação mais conservadora. O foco da estratégia se dá nas posições compradoras.

A abertura de contratos e aumento de posição é feita conforme algumas condições de tendência, de retorno à média. A primeira entrada possui um aumento de posição fixo. Eventuais novos aumentos de posição não serão mais baseados na condição de preço médio apenas, mas baseados também na tendência. Sendo assim, a estratégia possui entradas contra e a favor da tendência.

O encerramento das operações se dá na somatória de pontos pré-definidos de acordo com o número e regiões de preços em que os lotes foram abertos, ou seja, quanto mais lotes estiverem abertos, maior será o take profit financeiro. O take profit médio em pontos será o mesmo de todas as operações. O que vai variar, portanto, é o financeiro conforme a quantidade de lotes abertos. Abaixo seguem imagens que ilustram alguns encerramentos ocorridos em nossa conta real:



O rebaixamento histórico estatístico, máximo, em backtest da Go! Fusion, desde junho de 2019, é menor que 1.420 dólares antes de atingir o objetivo com realização positiva. O encerramento das operações se dá na somatória de pontos pré-definidos de acordo com o número e regiões de preços.

O projeto GO! FUSION é do tipo 'swing trade' em posições compradoras, "long". A recomendação de capital mínima é de U\$ 570,00 para cada 0.01. Atualmente, o lote mínimo permitido para a abertura de posições pela corretora ActivTrades no ativo Bra50 é de 0.05, podendo, a partir daí, abrir lotes de 0.06, 0.07, e assim sucessivamente...

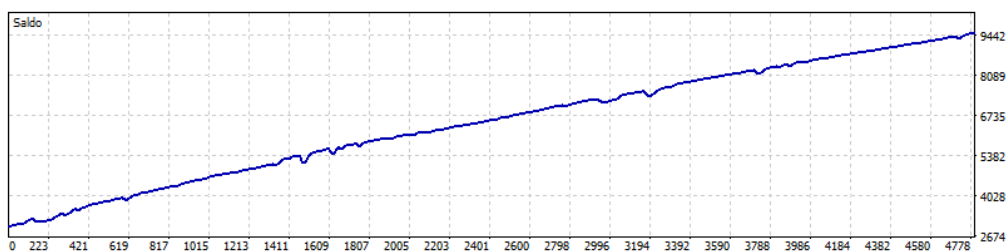
O capital conservador recomendado para a exposição mínima de múltiplos de 0,01 é de U\$ 1,000.00.

Resultados em backtest da estratégia utilizando lote 0.05 no período de 10/06/2019 a 03/08/2021:

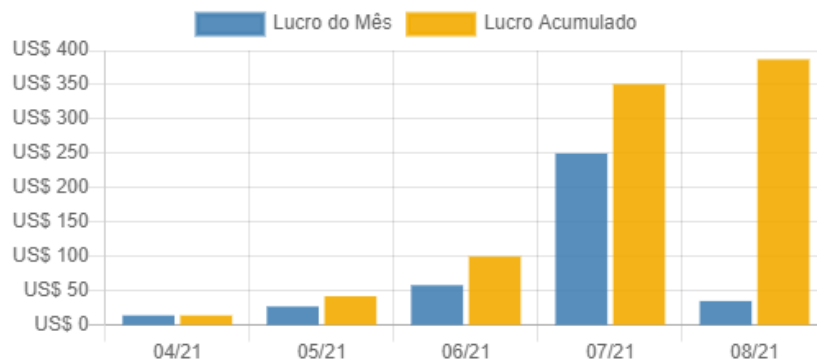
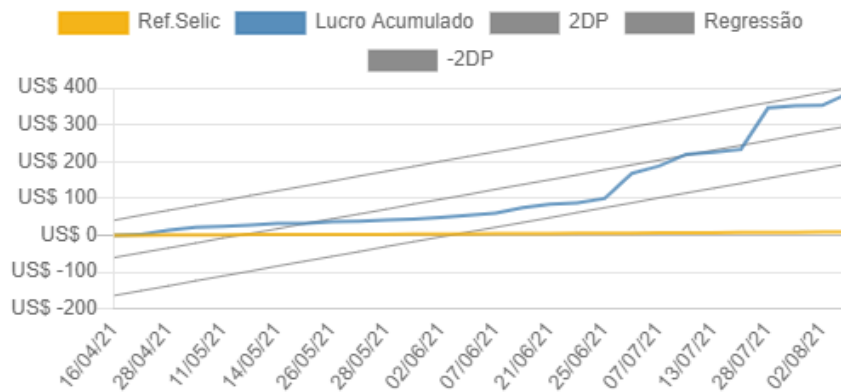
Corretora: **ActivTrades Corp**
 Moeda: **USD**
 Depósito Inicial: **3 000.00**
 Alavancagem: **1:150**

Resultados

Qualidade do histórico:	97%	Ticks:	60583944	Ativos:	1
Barras:	283755	Rebaixamento Absoluto do Saldo :	0.00	Rebaixamento Absoluto do Capital Líquido:	1 107.14
Lucro Líquido Total:	6 494.54	Rebaixamento Máximo do Saldo :	275.17 (5.09%)	Rebaixamento Máximo do Capital Líquido:	1 376.80 (42.11%)
Lucro Bruto:	8 525.97	Rebaixamento Relativo do Saldo :	5.09% (275.17)	Rebaixamento Relativo do Capital Líquido:	42.11% (1 376.80)
Perda Bruta:	-2 031.43	Retorno Esperado (Payoff):	1.36	Nível de Margem:	552.53%
Fator de Lucro:	4.20	Índice de Sharpe:	0.44	Z-Pontuação:	-55.61 (99.74%)
Fator de Recuperação:	4.72	Correlação LR :	1.00	Resultado OnTester:	4.717126670540376
AHPR:	1.0002 (0.02%)	Erro Padrão LR :	124.40		
GHPR:	1.0002 (0.02%)				
Total de Negociações:	4775	Posições Vendidas (% e ganhos):	1 (0.00%)	Posições Compradas (% de ganhos):	4774 (86.70%)
Ofertas Total:	9550	Negociações com Lucro (% of total):	4139 (86.68%)	Negociações com Perda (% of total):	636 (13.32%)
		Maior lucro da negociação:	17.08	Maior perda na Negociação:	-21.30
		Média lucro da negociação:	2.06	Média perda na Negociação:	-3.19
		Máximo ganhos consecutivos (\$):	276 (455.81)	Máximo perdas consecutivas (\$):	39 (-108.24)
		Máxima lucro consecutivo (contagem):	455.81 (276)	Máxima perda consecutiva (contagem):	-275.17 (14)
		Média ganhos consecutivos:	38	Média perdas consecutivas:	6



Resultados em conta real da estratégia utilizando lote 0.01 no período de 16/04/2021 até o dia 21/06/2021 e lote 0.05 a partir de 22/06/2021:



A Go! Signal sempre atenta ao mercado e no intuito de oferecer aos seus clientes o que há de melhor em estratégias automatizadas, desenvolveu o Projeto Go! Fusion que consiste basicamente em uma estratégia criada para operar o ativo Bra50 na corretora ActivTrades, visando sempre o longo prazo. Importante salientar que estatisticamente (com base em backtests) o tempo máximo de duração observado para encerramento de todas as posições foi de 21 dias conforme imagem abaixo, o que traz maior segurança e confiabilidade na consistência da estratégia. Além disso, já que o encerramento das operações se dá por preço médio, o somatório das posições sempre fecha no lucro, fato observado, inclusive, em períodos complicados como o famoso Joesley Day e o início da pandemia do Covid-19.

