



<CODE>TRADING

Uma empresa especializada no desenvolvimento de soluções para o mercado financeiro.

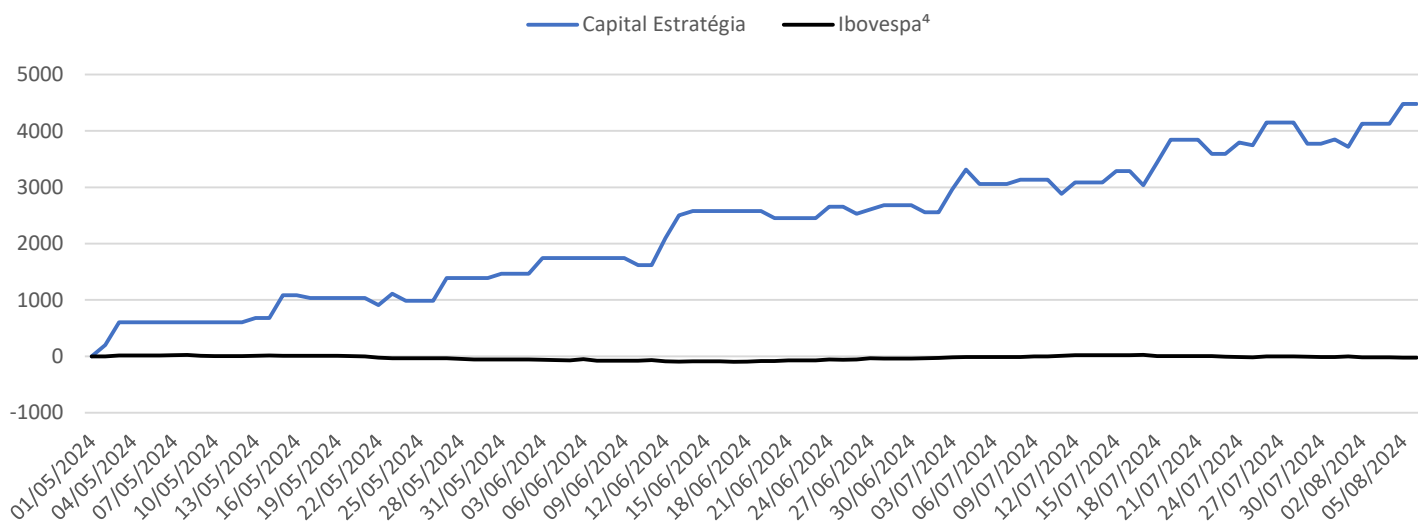
Parceiro: Ferrari Bots ¹

Informações gerais

Breve Descrição

Nome da estratégia	MF F430-B	Estratégia de rompimento de Bandas buscando um Momentum
Data do estudo	Agosto de 2024	
Estratégia	DayTrade	
Tipo de estratégia	Não Especificado	Utiliza parâmetros para proteção do lucro e alvo de TP.
Ativo	BIT\$N	
Contratos	1	
Capital recomendado ²	R\$ 4.500,00	
Tipo de entrada	A Mercado	
Aumento de posição?	Não	
Martingale ³ ?	Sim	

Desempenho histórico da estratégia [R\$]

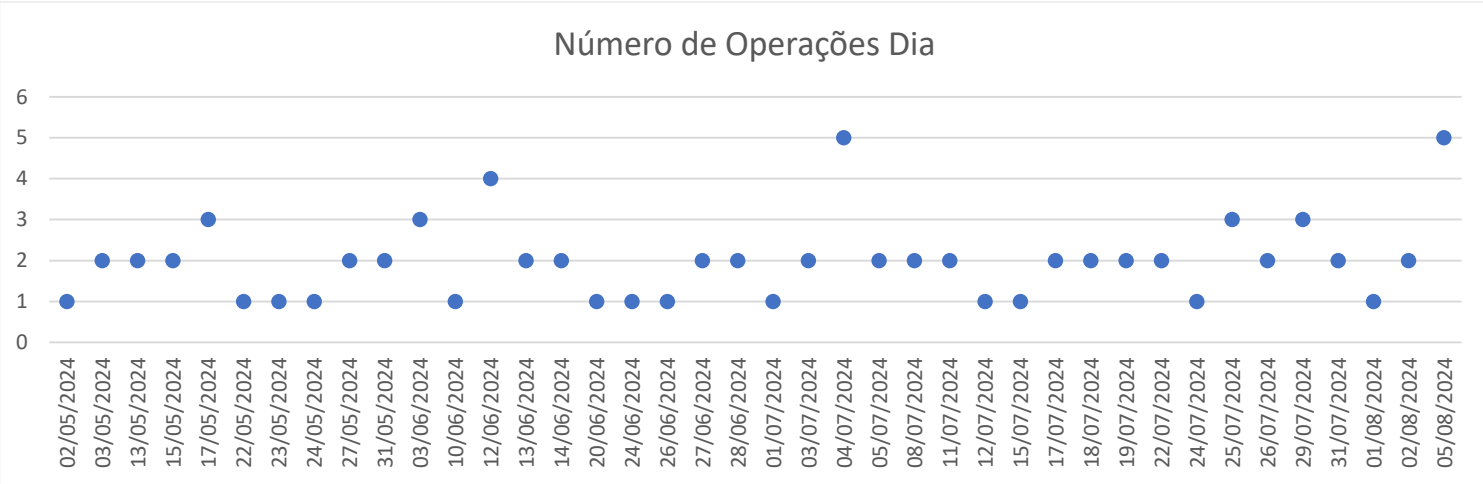
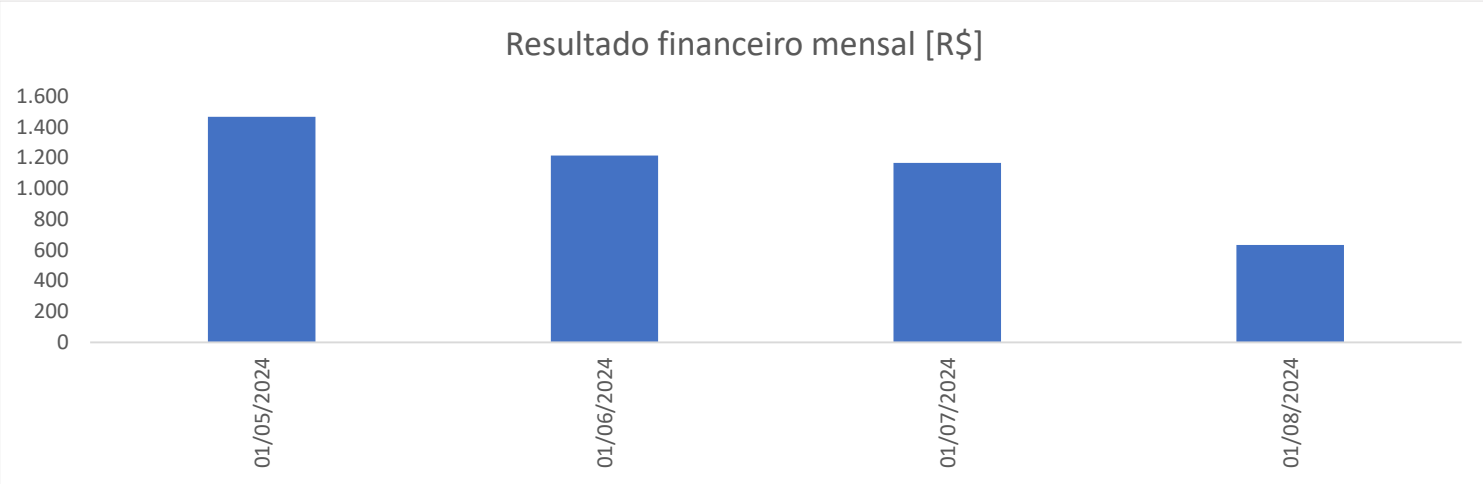
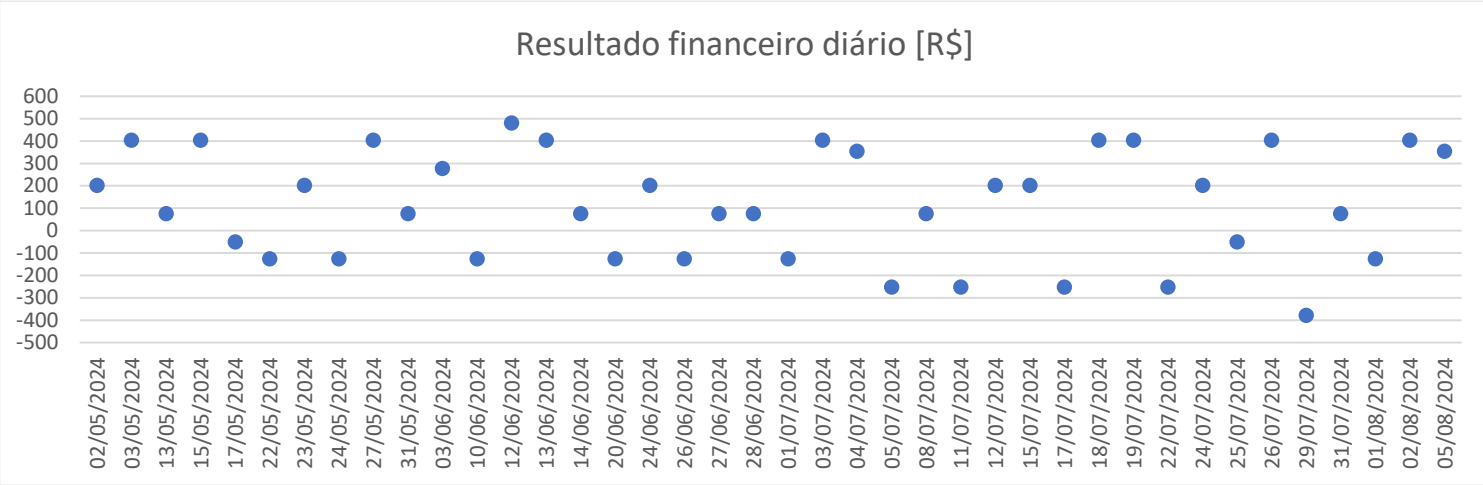


¹ Ferrari Bots é parceiro CodeTrading e desenvolve suas estratégias no robô Stark. Tem como desenvolvedor(es) das estratégias Equipe de estrategistas CodeTrading.

² O Capital Mínimo para operar o setup com o lote de 1 mini-contrato é dado utilizando Simulação de Monte Carlo e Critério de Kelly.

³ Martingale: Técnica que consiste no aumento consecutivo do valor das operações em caso de perda, aumentando o risco da estratégia.

⁴ Fonte: Yahoo! Finance, <<https://br.financas.yahoo.com/quote/%5EBVSP/history?p=%5EBVSP>> Acesso em: 06 ago 2024.





Resultados⁵

Parâmetros da simulação

Data inicial	06/08/2023
Data final	05/08/2024
Dias de pregão	261
Total de meses	12
Custos por operação ⁶	R\$ 0,40

Informação sobre operações

Total de operações	79
Média de operações por dia	0,30
Máximo de operações diárias	5
Percentual de acerto	55,70%

Financeiro por operação

Ganho máximo	R\$202,00
Perda máxima	-R\$126,00
Ganho médio	R\$202,00
Perda média	-R\$126,00
Retorno esperado (Payoff)	R\$ 56,68

Informações globais

Lucro Bruto	R\$8.888,00
Perda Bruta	-R\$4.410,00
Lucro Líquido Total	R\$4.478,00
Fator de lucro	2,02
Drawdown máximo ⁷	-R\$478,00

Informação sobre risco diário

Perda máxima diária ⁸	-R\$ 378,00
Ganho máximo diário ⁸	R\$ 480,00

⁵Operações realizadas no simulador de Backtest do MetaTrader 5, em um período histórico de 12 meses que abrange diferentes momentos do mercado.

⁶Custos por operação: custo médio considerado na simulação (corretagem, emolumentos, custódia, ISS, taxa de liquidação). Utilizamos um valor acima da média do mercado, com o objetivo de avaliar o desempenho da estratégia no pior cenário de custos.

⁷Drawdown máximo é a maior queda financeira acumulada ao longo do período histórico considerado.

⁸Esses valores podem variar de acordo com a liquidez do mercado na hora do envio das ordens de saída.

A responsabilidade da tomada de decisão, parametrização e ativação do robô é única e exclusiva do investidor. A CodeTrading é uma empresa que fornece robôs de investimentos para investidores e traders que possuem o perfil de risco agressivo, e sua utilização deve ser liberada pela corretora apenas após o preenchimento da Análise de Perfil do Investidor (API), conforme Resolução CVM nº 30.

Investimentos em renda variável envolvem risco e podem resultar em perdas, por isso ressalta-se que recomendamos a utilização de um portfólio de robôs para diversificação de risco.

Os resultados passados publicados nesta lâmina foram produzidos em ambiente simulado. Ressaltamos que lucros passados jamais serão garantia de resultado no futuro.

Os parceiros homologados pela CodeTrading executam na plataforma MetaTrader 5 em conta real da Corretora XP e Genial Investimentos todas suas estratégias automatizadas, fornecidas conforme descritas nas Lâminas em PDF, operando o lote mínimo do ativo negociado em seu setup para fins de auditoria das estratégias em conta real por parte de nossos clientes.

O analista responsável pelo conteúdo dos relatórios de análise, deferimento das estratégias automatizadas e pelo cumprimento da Resolução CVM 20 é o Marco Antonio do Nascimento, Analista CNPI-T 4698. Os analistas da CodeTrading estão obrigados ao cumprimento de todas as regras previstas no Código de Conduta da APIMEC para o Analista de Valores Mobiliários.

CodeTrading - Av Nove de Julho, 3575, 10º andar, sala 1001 - Jundiaí/SP - Brasil - contato@codetrading.com.br - +55 (19) 4042-0717