

AUTOMAÇÃO DTRENKO





Observação Estratégica — Análise Integrada dos Indicadores

Nenhum indicador isolado é capaz de representar, de forma fiel, a qualidade real de um sistema de trading. Sistemas profissionais e sustentáveis surgem do **equilíbrio entre métricas de qualidade, eficiência, frequência e risco**. A leitura correta deve sempre considerar o **conjunto dos indicadores**, e não apenas um número destacado.

Principais Métricas para Sistemas de Trading

SQN



O que é SQN?

O SQN (System Quality Number) mede a **robustez estatística e a consistência** dos resultados do sistema, **combinando retorno médio**, volatilidade e número de operações.

Ele indica se o **desempenho** observado é estrutural ou fruto de eventos aleatórios.

$$\text{Fórmula: } SQN = \frac{R}{\text{Desvio Padrão}} \sqrt{n}$$

< 1.6 1.6 1.9 2.7 2.7 > 3.0

Profit Factor – Eficiência Financeira

Indica quanto o sistema ganha para cada unidade monetária perdida.

Revela margens reais, eficientes e sustentáveis.

Revela se os ganhos são suficientes para cobrir custos e riscos.



$$\text{Fórmula: Profit Factor} = \frac{\text{Ganhos Totais}}{\text{Perdas Totais}}$$

Winrate – Frequência de Acerto

O que é Winrate?

$$\text{Winrate} = \frac{\text{N}^\circ \text{ de Trades Ganhos}}{\text{N}^\circ \text{ de Trades Totais}}$$

Muito Baixo < 35% Baixo 35%-45% Equilibrado 46-55% Bom 55%-65% Excelente > 65%

Drawdown – Risco e Sobrevivência

O que é Drawdown?

$$\text{Drawdown} = \frac{\text{Ponto Máximo} - \text{Ponto Mínimo}}{\text{Ponto Máximo}} \times 100$$



- ✓ Drawdown representa a maior perda acumulada do capital entre altas e recuperação.
- ✓ É o principal indicador de risco prático e impacto emocional do sistema.

Winrate

Percentual de operações vencedoras.

$$\text{Winrate} = (\text{Trades Positivos} / \text{Total de Trades}) \times 100$$



Profit Factor

Quanto o robo ganha
para cada 1 unidade perdida.

$$\text{Profit Factor} = \frac{\text{Ganhos Totais}}{\text{Perdas Totais}}$$

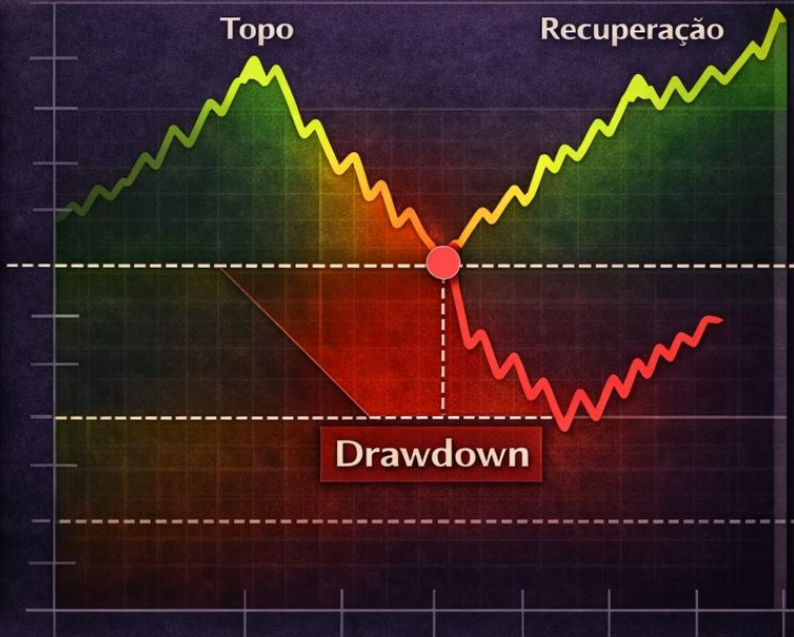


Drawdown

Classificação de Drawdown – Benchmark Institucional (Peak-to-Trough)

Maior queda acumulada do capital antes da recuperação.

| Classificação |
|------------------------|
| Conservador < 20% |
| Aceitável 20% – 30% |
| Agressivo 30% – 40% |
| Critico > 40% |



SQN (System Quality Number)

Mede a qualidade estatística do sistema.

$$\text{SQN} = \text{Média dos Resultados} / \text{Desvio Padrão} \times \sqrt{\text{N}^\circ \text{ de Trades}}$$

| | | | | |
|--------------|----------------|------------|------------------|------------------|
| Fraco | Regular | Bom | Muito Bom | Excelente |
| < 1.6 | 1.6 – 1.9 | 2.0 – 2.4 | 2.5 – 2.9 | ≥ 3.0 |



PERFORMANCE DO ROBO

ÍNDICE- 6R - 15:30

SALDO

R\$ 1.988,00

POR CONTRATO

9.940 PONTOS
345 OPERAÇÕES

WIN RATE

60%

DIAS POSITIVOS

64 DIAS

DIAS NEGATIVOS

42 DIAS

DRAWDOWN

810 PONTOS

PROFIT FACTOR

1,65

SQN

4,66

DTRENKOrobo
LITE

CLASSIFICAÇÃO PROFIT FACTOR



CLASSIFICAÇÃO VAN THARP (SQN)



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530 - Diário



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530 - Semanal



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530 - Mensal



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530.xlsx • RELATÓRIO DE DRAWDOWN CLÁSSICO



MÉTRICAS DE RISCO

Drawdown Máx (Pts): -810
Drawdown Máx (%): -9.96%

Topo: 19/11/2025
Fundo: 28/11/2025

Duração do Drawdown:

- Trades: 11
- Dias: 8

Recuperação:

- Trades: 10
- Dias: 5

Classificação de Risco: BAIXO

- Estratégia **robusta e estável**
- Adequada para **preservação de capital**
- Comum em fundos conservadores e mandatos defensivos

Tabela de Projeção de Resultado por quantidade de Contratos

| CONTRATOS | SALDO EM R\$ |
|-----------|--------------|
| 1 | R\$ 1.988 |
| 2 | R\$ 3.976 |
| 3 | R\$ 5.964 |
| 4 | R\$ 7.952 |
| 5 | R\$ 9.940 |
| 6 | R\$ 11.928 |
| 7 | R\$ 13.916 |
| 8 | R\$ 15.904 |
| 9 | R\$ 17.892 |
| 10 | R\$ 19.880 |

Saldo em pontos: 9.940

Valor por contrato: R\$1.988



PERFORMANCE DO ROBO

ÍNDICE- 6R - 17:00

SALDO

R\$ 2.101,00

POR CONTRATO

10.505 PONTOS
386 OPERAÇÕES

WIN RATE

60%

DIAS POSITIVOS

64 DIAS

DIAS NEGATIVOS

42 DIAS

DRAWDOWN

810 PONTOS

PROFIT FACTOR

1,69

SQN

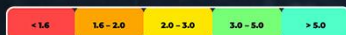
4,66

DTRENKO **robo**
LITE

CLASSIFICAÇÃO PROFIT FACTOR



CLASSIFICAÇÃO VAN THARP (SQN)



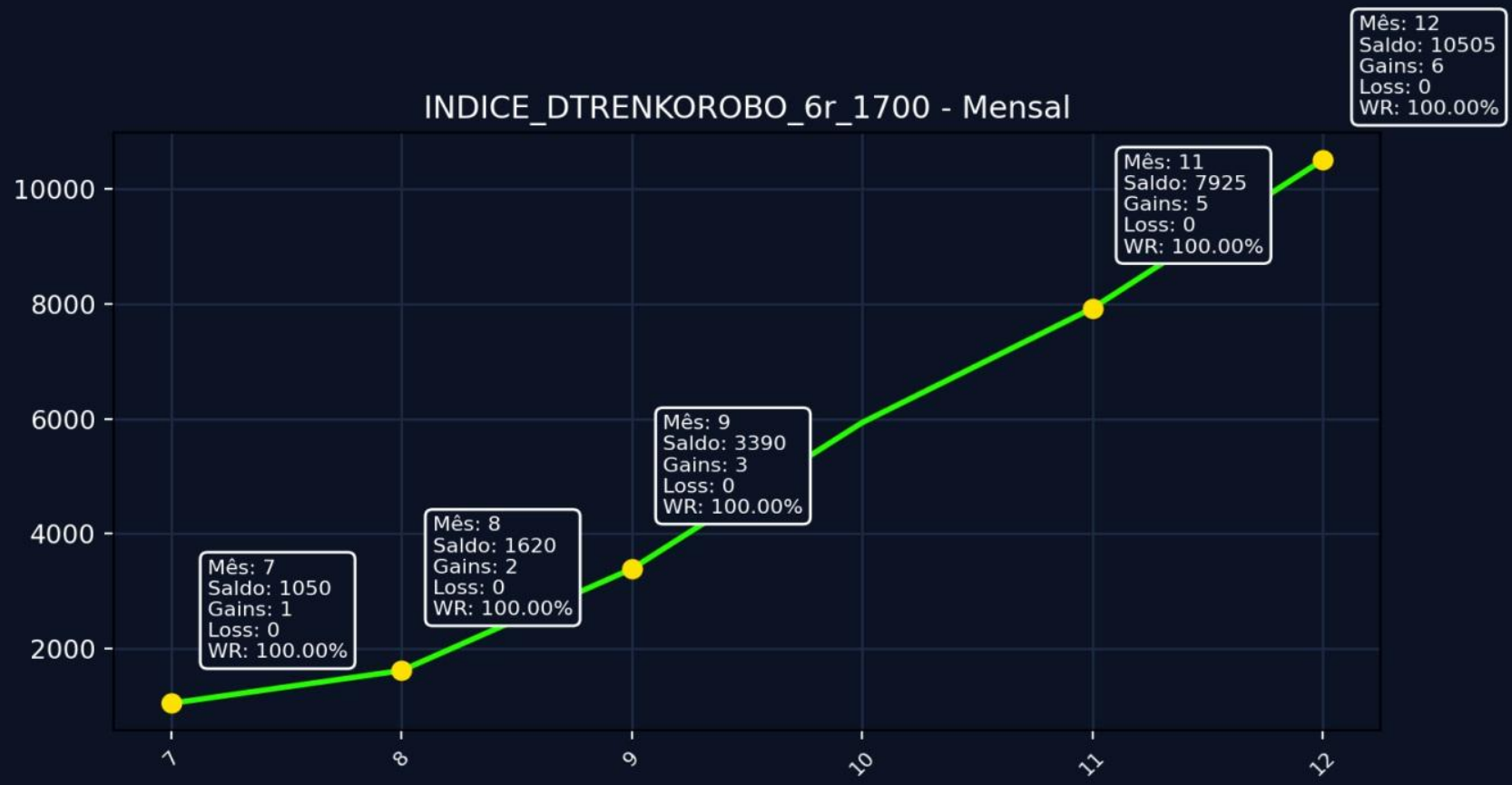
INDICE_DTRENKOROBO_6r_1700 - Diário



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1700 - Semanal



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1700 - Mensal



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1700.xlsx • RELATÓRIO DE DRAWDOWN CLÁSSICO



MÉTRICAS DE RISCO

Drawdown Máx (Pts): -810
Drawdown Máx (%): -9.96%

Topo: 16/12/2025
Fundo: 19/12/2025

Duração do Drawdown:

- Trades: 15
- Dias: 3

Recuperação:

- Trades: Não recuperado
- Dias: Não recuperado

Classificação de Risco: BAIXO

- Estratégia **robusta e estável**
- Adequada para **preservação de capital**
- Comum em fundos conservadores e mandatos defensivos

Tabela de Projeção de Resultado por quantidade de Contratos

| CONTRATOS | SALDO EM R\$ |
|-----------|--------------|
| 1 | R\$ 2.101 |
| 2 | R\$ 4.202 |
| 3 | R\$ 6.303 |
| 4 | R\$ 8.404 |
| 5 | R\$ 10.505 |
| 6 | R\$ 12.606 |
| 7 | R\$ 14.707 |
| 8 | R\$ 16.808 |
| 9 | R\$ 18.909 |
| 10 | R\$ 21.010 |

Saldo em pontos: 10.505

Valor por contrato: R\$2.101



PERFORMANCE DO ROBO

ÍNDICE- 8R - 15:30

SALDO

R\$ 3.055,00

POR CONTRATO

15.275 PONTOS

367 OPERAÇÕES

WIN RATE

67%

DIAS POSITIVOS

80 DIAS

DIAS NEGATIVOS

38 DIAS

DRAWDOWN

1190 PONTOS

PROFIT FACTOR

1,75

SQN

5,06

DTRENKO **robo**
LITE

CLASSIFICAÇÃO PROFIT FACTOR



CLASSIFICAÇÃO VAN THARP (SQN)



INDICE_DTRENKOROBO_8r - 1530 - Semanal

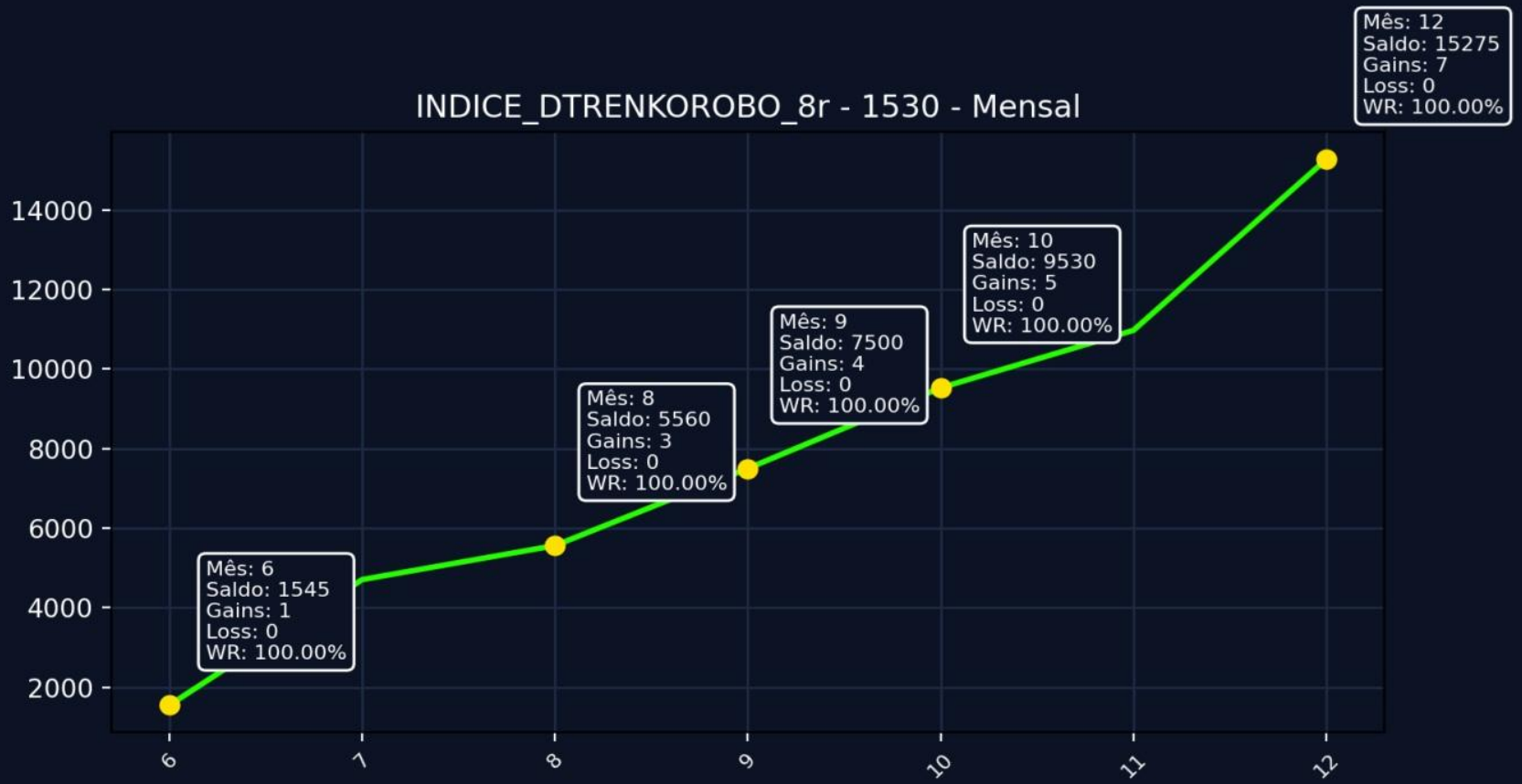


Semana: 51
Saldo: 15275
Gains: 21
Loss: 3
WR: 87.50%

Daily Running Total



INDICE_DTRENKOROBO_8r - 1530 - Mensal



INDICE_DTRENKOROBO_8r - 1530.xlsx • RELATÓRIO DE DRAWDOWN CLÁSSICO



MÉTRICAS DE RISCO

Drawdown Máx (Pts): -119.0
Drawdown Máx (%): -19.82%

Topo: 21/08/2025
Fundo: 25/08/2025

Duração do Drawdown:

- Trades: 13
- Dias: 4

Recuperação:

- Trades: 20
- Dias: 10

Classificação de Risco: MODERADO

- Estratégia **robusta e estável**
- Adequada para **preservação de capital**
- Comum em fundos conservadores e mandatos defensivos

Tabela de Projeção de Resultado por quantidade de Contratos

| CONTRATOS | SALDO EM R\$ |
|-----------|--------------|
| 1 | R\$ 3.055 |
| 2 | R\$ 6.110 |
| 3 | R\$ 9.165 |
| 4 | R\$ 12.220 |
| 5 | R\$ 15.275 |
| 6 | R\$ 18.330 |
| 7 | R\$ 21.385 |
| 8 | R\$ 24.440 |
| 9 | R\$ 27.495 |
| 10 | R\$ 30.550 |

Saldo em pontos: 15.275
Valor por contrato: R\$3.055



PERFORMANCE DO ROBO

ÍNDICE- 8R - 17:00

SALDO

R\$ 2.868,00

POR CONTRATO

14.340 PONTOS

424 OPERAÇÕES

WIN RATE

64%

DIAS POSITIVOS

87 DIAS

DIAS NEGATIVOS

49 DIAS

DRAWDOWN

1300 PONTOS

PROFIT FACTOR

1,57

SQN

4,4

DTRENKO robo
LITE

CLASSIFICAÇÃO PROFIT FACTOR



CLASSIFICAÇÃO VAN THARP (SQN)

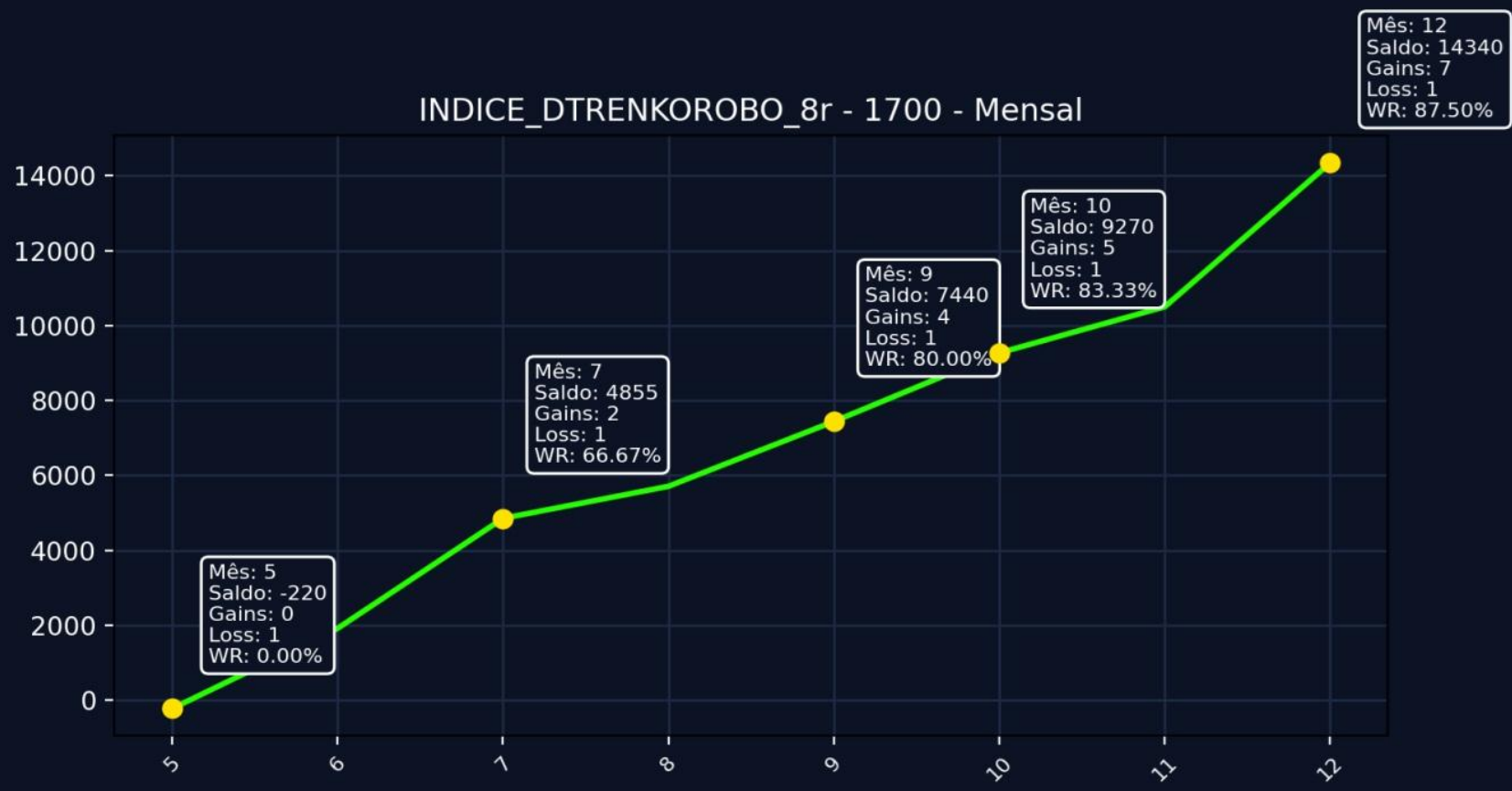




Weekly Running Total



INDICE_DTRENKOROBO_8r - 1700 - Mensal



INDICE_DTRENKOROBO_8r - 1700.xlsx • RELATÓRIO DE DRAWDOWN CLÁSSICO



MÉTRICAS DE RISCO

Drawdown Máx (Pts): -1300
Drawdown Máx (%): -19.37%

Topo: 21/08/2025
Fundo: 25/08/2025

Duração do Drawdown:

- Trades: 12
- Dias: 4

Recuperação:

- Trades: 20
- Dias: 10

Classificação de Risco: MODERADO

- Estratégia **robusta e estável**
- Adequada para **preservação de capital**
- Comum em fundos conservadores e mandatos defensivos

Tabela de Projeção de Resultado por quantidade de Contratos

| CONTRATOS | SALDO EM R\$ |
|-----------|--------------|
| 1 | R\$ 2.688 |
| 2 | R\$ 5.376 |
| 3 | R\$ 8.064 |
| 4 | R\$ 10.752 |
| 5 | R\$ 13.440 |
| 6 | R\$ 16.128 |
| 7 | R\$ 18.816 |
| 8 | R\$ 21.504 |
| 9 | R\$ 24.192 |
| 10 | R\$ 26.880 |

Saldo em pontos: 14.340
Valor por contrato: R\$2.688



PERFORMANCE DO ROBO

ÍNDICE- 6R - 15:30 - AGRESSIVO

SALDO

R\$ 2.842,00

POR CONTRATO

14.210 PONTOS

651 OPERAÇÕES

WIN RATE

67%

DIAS POSITIVOS

75 DIAS

DIAS NEGATIVOS

37 DIAS

DRAWDOWN

665 PONTOS

PROFIT FACTOR

1,5

SQN

4,6

DTRENKOrobo
LITE

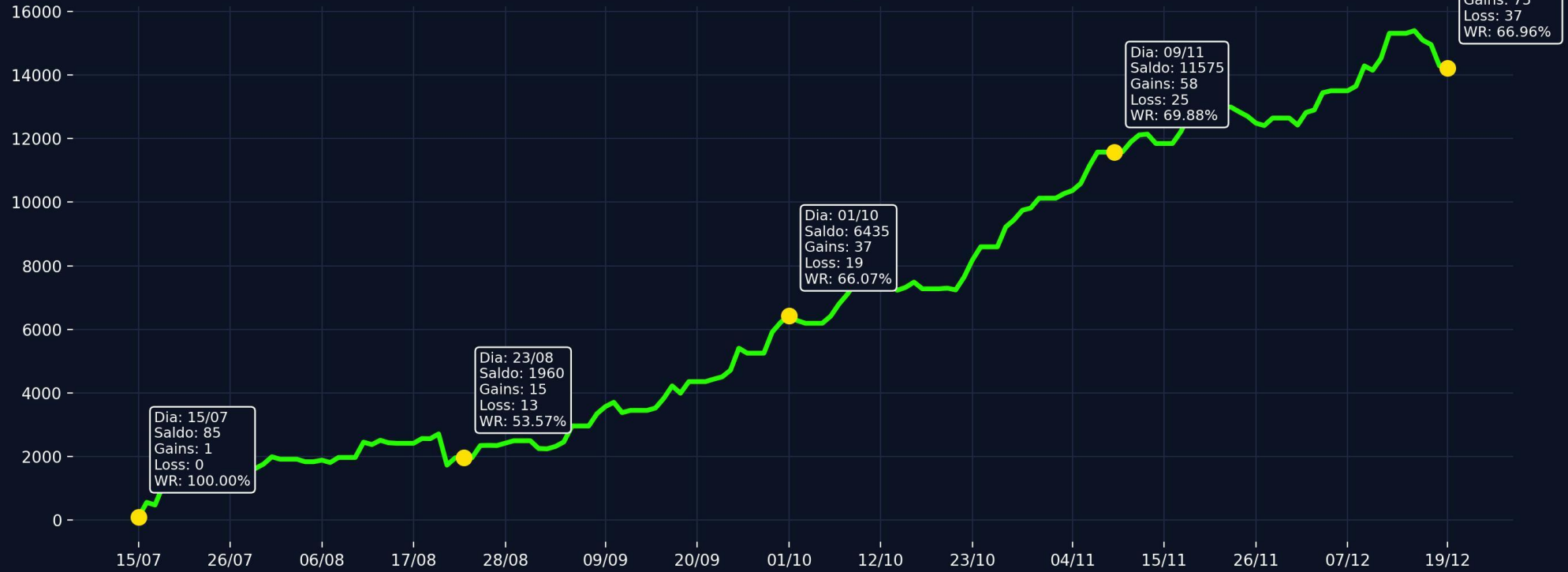
CLASSIFICAÇÃO PROFIT FACTOR



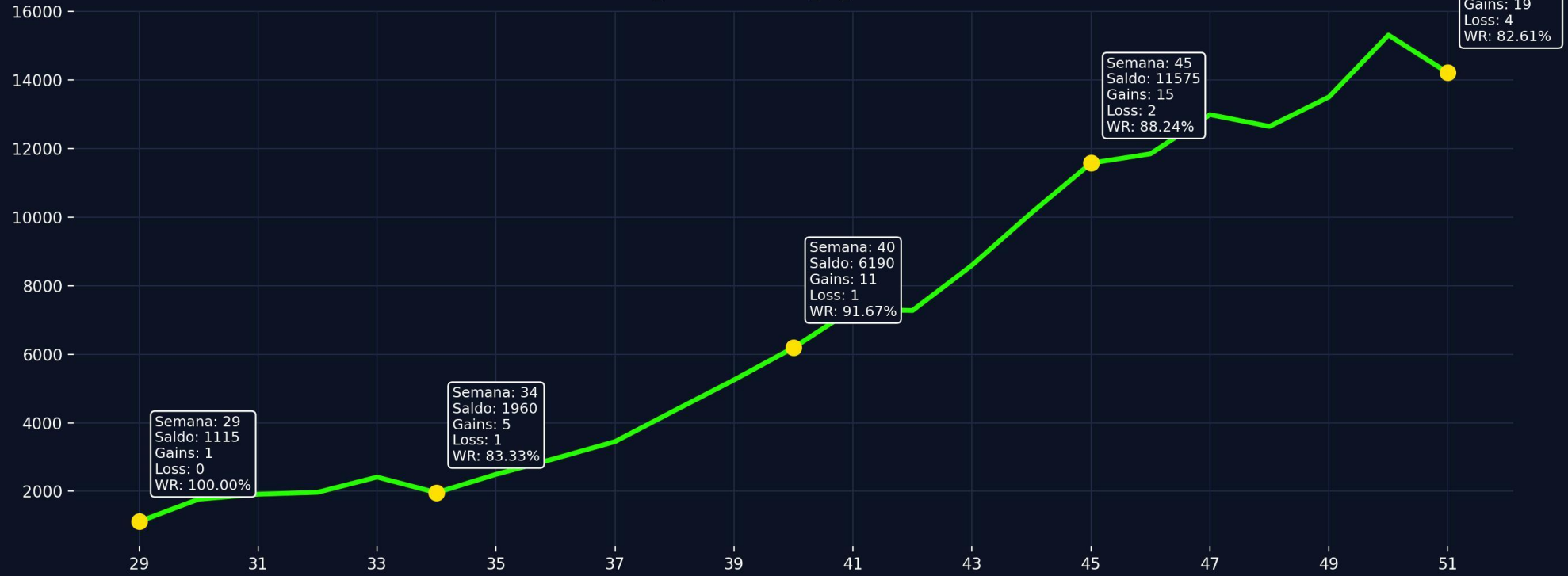
CLASSIFICAÇÃO VAN THARP (SQN)



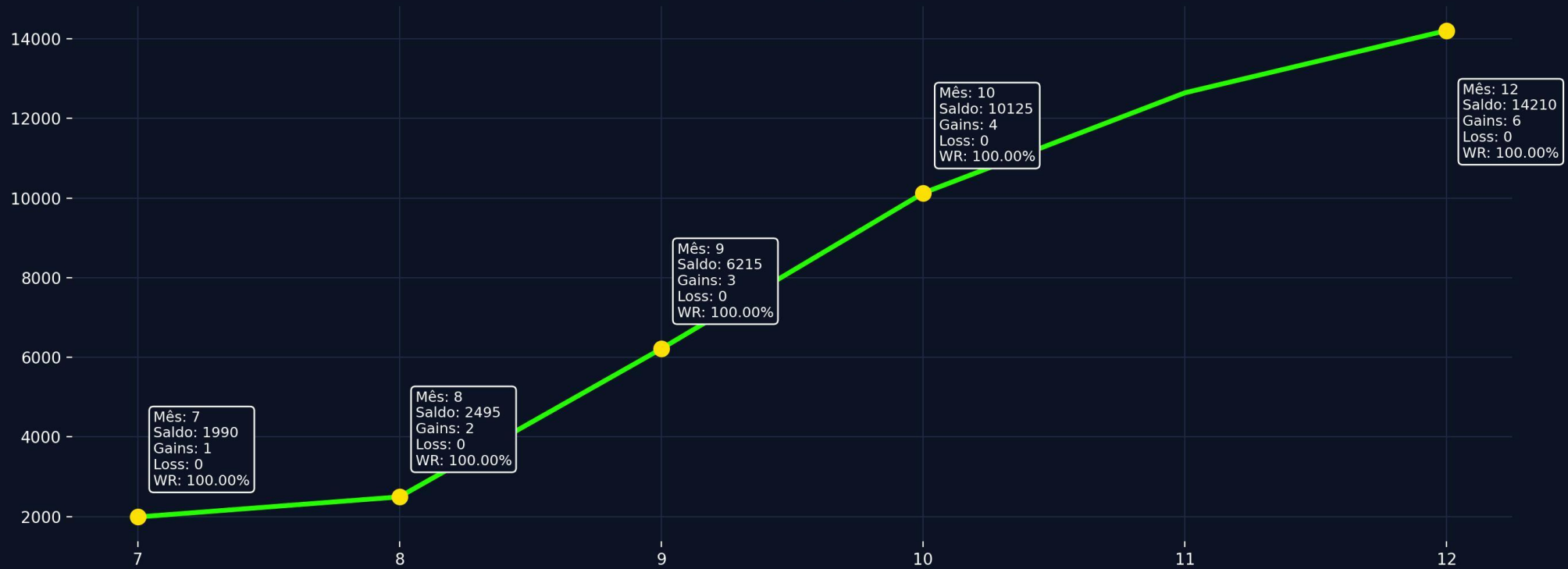
INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530 - Diário



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530 - Semanal



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530 - Mensal



INDICE_DTRENKOROBO_6r_1530-Agressivo.xlsx • RELATÓRIO DE DRAWDOWN CLÁSSICO



MÉTRICAS DE RISCO

Drawdown Máx (Pts): -1480

Drawdown Máx (%): -9.52%

Topo: 16/12/2025

Fundo: 19/12/2025

Duração do Drawdown:

- Trades: 32

- Dias: 3

Recuperação:

- Trades: Não recuperado

- Dias: Não recuperado

Classificação de Risco: BAIXO

- Estratégia **robusta e estável**
- Adequada para **preservação de capital**
- Comum em fundos conservadores e mandatos defensivos

Tabela de Projeção de Resultado por quantidade de Contratos

| CONTRATOS | SALDO EM R\$ |
|-----------|--------------|
| 1 | R\$ 2.842 |
| 2 | R\$ 5.684 |
| 3 | R\$ 8.526 |
| 4 | R\$ 11.368 |
| 5 | R\$ 14.210 |
| 6 | R\$ 17.052 |
| 7 | R\$ 19.894 |
| 8 | R\$ 22.736 |
| 9 | R\$ 25.578 |
| 10 | R\$ 28.420 |

Saldo em pontos: 14.210
Valor por contrato: R\$2.842

Observação Estratégica — Análise Integrada dos Indicadores

Os resultados apresentados demonstram uma **automação estatisticamente robusta, consistente e operacionalmente madura**. Com a faixa entre **345 e 651 operações**, a estratégia apresenta **amostragem suficiente** para validação técnica, reduzindo significativamente o risco de desempenho aleatório.

O **saldo positivo de entre 9.940 pontos (R\$ 1.988,00 por contrato) e 15.275 pontos (R\$ 3.055,00 por contrato)** aliado a um **Win Rate acima de 60%** indica uma **dinâmica operacional equilibrada**, com boa frequência de acertos e controle das perdas.

O **Profit Factor acima 1,5** confirma eficiência econômica adequada, mostrando que os ganhos superam as perdas com margem suficiente para absorver custos operacionais.

O destaque técnico fica para o **SQN acima de 4,4**, nível considerado **excelente em padrões estatísticos**, evidenciando alta qualidade do sistema, consistência dos resultados e baixa variabilidade relativa entre os trades.

Do ponto de vista de risco, o **Drawdown máximo de 1300 pontos (-19,82%)** enquadra a estratégia em um **perfil máximo como moderado, sendo que em diversas situações como baixo**, o que reforça a **capacidade de sobrevivência e estabilidade no longo prazo**.