

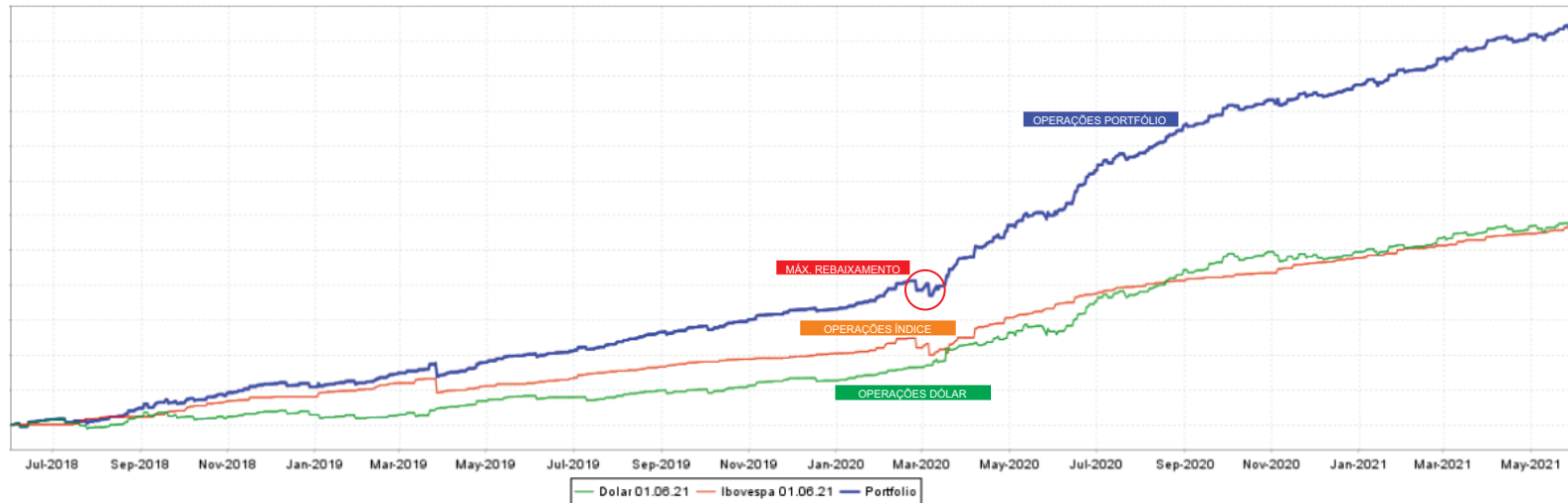
QUANT ANALYZER PORTFOLIO REPORT

Atualização 01/06/2021

Symbols/Strategies in Portfolio

Name	Net Profit	Drawdown	Trades	Profit Factor	Sharpe Ratio	Return/DD Ratio	AVG. Trade
E-I Dolar OPERAÇÕES DÓLAR	142,55%	-7,76%	468	2.18	0.23	18.38	0,30%
E-I Ibovespa OPERAÇÕES ÍNDICE	141,44%	-12,06%	373	5.89	0.33	11.73	0,38%
Portfolio OPERAÇÕES EM AMBOS	283,99%	-10,47%	841	2.9	0.28	27.12	0,34%

Total Profit 283,99% LUCRO TOTAL (36 MESES)	# OF TRADES	SHARPE RATIO	PROFIT FACTOR	WINNING OPERAÇÕES VENCEDORAS / ACERTOS
YEARLY AVG RETURN 94,66% RETORNO MÉDIO ANUAL	841	0.28	2.9	92.63%
	DRAWDOWN MÁX. REBAIXAMENTO	DAILY AVG PROFIT	MONTHLY AVG PROFIT LUCRO MÉDIO MENSAL	AVERAGE TRADE
	-10,47%	0,26%	7,89%	0,34%



Resume Performance

Period	Net Profit	Profit Factor	Trades	Wins
All	283,99%	2.9	841	92.63%
2021	40,32%	2.74	117	89.74%
2020	160,80%	3.23	324	91.67%
2019	55,70%	2.86	267	95.51%
2018	27,18%	2.15	133	91.73%

Correlation base on Profit/loss by Hour

Lower correlation Better diversification	< 0.4 MODERATE	0.4 - 0.7 MODERATE HIGH	0.8 - 1.0 HIGH	Higher correlation Worse diversification
E-I Dolar			-0.12	
E-I Ibovespa	-0.12			

Monthly Performance **PERFORMANCE MENSAL**

Year	Jan	Fev	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
2021	10,69%	7,98%	10,55%	6,53%	4,58%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	40,32%
2020	9,55%	4,27%	23,11%	23,14%	7,25%	MELHOR MÊS 32,13%	12,47%	19,71%	12,61%	5,80%	4,83%	5,93%	160,80%
2019	2,86%	7,20%	-1,61%	9,27%	5,78%	2,20%	6,24%	7,32%	4,37%	4,44%	6,88%	0,76%	55,70%
2018	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	3,96%	-1,06%	9,08%	3,71%	7,03%	6,54%	PIOR MÊS -2,06%	27,18%

Data powered by



Este relatório foi criado com base em um teste do passado (backtest) utilizando parâmetros selecionados por otimização pelo sistema de IA, (Inteligência Artificial) da MetaQuotes Ltd. e compilado em relatório de portfólio da StrategyQuant utilizando os dados dos ativos fornecidos pela XP Investimentos CCTVM S/A. A responsabilidade de configuração e parametrização pertencem a cada usuário. Os desempenhos anteriores não são, necessariamente, indicativos de resultados futuros e nenhuma declaração ou garantia, de forma expressa ou implícita, é feita em relação a desempenhos futuros. O conteúdo apresentado neste relatório de teste passado não se trata de recomendação, indicação, análise ou aconselhamento de investimento. A rentabilidade passada (backtest) divulgada não considera impostos e custos operacionais.

Consulte material e informações diretamente na página oficial dos sistemas utilizados:

strategyquant.com/quantanalyzer
strategyquant.com
metaquotes.net/en/metatrader5/algorithmic-trading/tester