REPORT LAB · RAIO-X OPERACIONAL

Dossiê Trader

Robô VIXPRO (conta simulador) · exemplo · 08/10/2026 a 19/10/2026 · 220 operações em 6 dias

DT-EXEMPLO

01 Capa e veredito

Quem é este trader e o que os números dizem, numa página.

Perfil operacional

Período **08/10/2026 a 19/10/2026**	Dias operados **6**
Operações **220**	Frequência **36,7 por dia**
Ativos **WIN**	Execução **Robô (100% automação)**
Estratégias **1**	Estilo **Day trade**
Lote médio **1,0 contratos**	Custo por contrato **R$ 0,00**

Veredito



R$ 252,00

Expectativa **ainda inconclusiva (pode ser acaso)**. Acerto de 48,2% contra 43,6% necessários para empatar com o payoff de 1,29.

Faltam cerca de **369** operações com este padrão para a evidência ficar clara.

Evidência estatística t = 1,20 (3 = forte)	**10/25**
Vantagem (fator de lucro) fator 1,20	**5/25**
Risco (resultado ÷ drawdown) 1,31× o drawdown	**9/20**
Regularidade dos dias 67% dias positivos	**13/15**
Controle das perdas pior perda = 1,8× a média	**15/15**

Índice de consistência: nota interna que junta evidência, vantagem, risco, regularidade e controle das perdas. Descreve o histórico; não é recomendação.

02 Números-chave

A faixa que se lê em 5 segundos.

RESULTADO LÍQUIDO	TAXA DE ACERTO	PAYOFF	EXPECTATIVA	FATOR DE LUCRO
R$ 252,00 após custos	**48,2%** equilíbrio 43,6%	**1,29** R$ 14,19 / R$ 10,98	**R$ 1,15** IC95 −R$ 1 a R$ 3	**1,20** ganhos ÷ perdas

DRAWDOWN MÁXIMO	DIAS POSITIVOS	CHANCE DE FECHAR NO LUCRO
R$ 192,00 maior tempo abaixo do topo: 5 dias	**67%** 4 de 6	**98%** próximas 20 sessões (simulação)

03 Resultado no tempo

Como o dinheiro entrou e saiu, dia a dia.

Curva de capital e drawdown



Drawdown: distância ao topo em cada momento (máx. −R$ 192)

Ponto laranja = fundo do maior drawdown (R$ 192,00). Maior período sem novo topo: 5 dias.

Calendário de resultados

	seg	ter	qua	qui	sex
05/10				8	
12/10		13	14	15	16
19/10	19				

Azul = dia positivo, laranja = negativo; mais forte = maior. Passe o mouse para ver o valor.

Resultado por dia



Melhor dia
R$ 141,00
19/10/2026

Pior dia
-R$ 104,00
15/10/2026

O melhor dia vale 56% do resultado do período.

Ganhos e perdas por faixa de horário

PERDAS ← 0 → GANHOS · 30 MIN

-R$ 1.252,00 · R$ 1.504,00 · SALDO R$ 252,00

09:00	-R$ 80,00	R$ 42,00	-R$ 38,00
09:30	-R$ 191,00	R$ 113,00	-R$ 78,00
10:00	-R$ 215,00	R$ 76,00	-R$ 139,00
10:30	-R$ 80,00	R$ 275,00	R$ 195,00
11:00	-R$ 139,00	R$ 195,00	R$ 56,00
11:30	-R$ 121,00	R$ 169,00	R$ 48,00
12:00	-R$ 110,00	R$ 136,00	R$ 26,00
12:30	-R$ 96,00	R$ 165,00	R$ 69,00
13:00	-R$ 98,00	R$ 68,00	-R$ 30,00
13:30	-R$ 52,00	R$ 117,00	R$ 65,00
14:00	-R$ 70,00	R$ 115,00	R$ 45,00
14:30		R$ 33,00	R$ 33,00

04 Vantagem estatística

Há método ou ainda pode ser sorte?

Acerto real vs acerto de equilíbrio



seu acerto 48,2% (faixa = intervalo de 95%: 42% a 55%)

equilíbrio 43,6%

O intervalo do acerto ainda cruza o equilíbrio: a amostra não decide. O resultado vem sobretudo do payoff.

Painel de métricas

IC95 do acerto **41,7% a 54,8%**	IC95 da expectativa **-R$ 0,73 a R$ 3,02**
Sharpe por operação **0,08**	Sortino por operação **0,14**
Maior sequência de ganhos **13**	Maior sequência de perdas **9**
Melhor operação **R$ 71,00**	Pior operação **-R$ 20,00**
Ganho médio **R$ 14,19**	Perda média **-R$ 10,98**

05 Simulador de cenários

Mexa nas regras e veja, no próprio histórico, o que teria mudado.

Cenários "e se": simule regras no seu próprio histórico



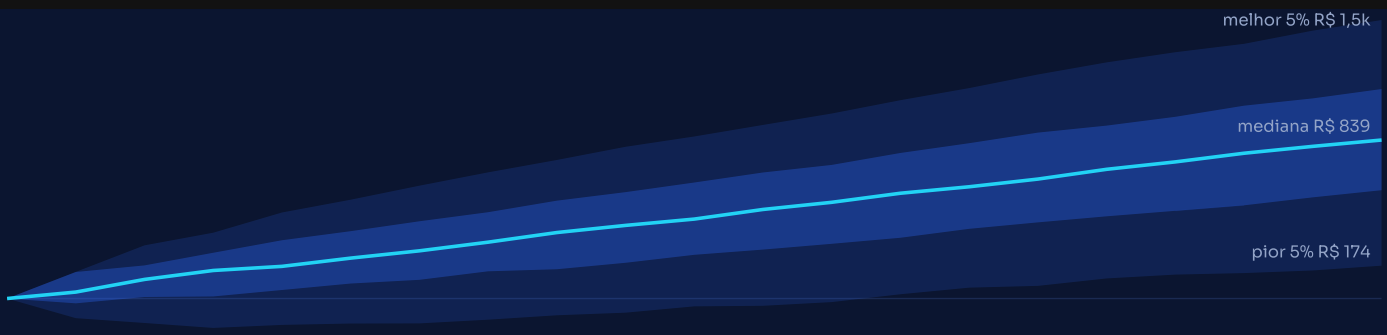
Métrica	Real	Cenário	Diferença
Resultado líquido	R$ 252,00	-R$ 81,00	-R$ 333,00
Operações	220	19	-201
Taxa de acerto	48,2%	26,3%	-21,9%
Expectativa por operação	R$ 1,15	-R$ 4,26	-R$ 5,41
Fator de lucro	1,20	0,50	-0,70
Drawdown máximo	R$ 192,00	R$ 112,00	-R$ 80,00

O cenário removeu 201 operações e piorou o resultado em R$ 333,00.

Projetar este cenário no cone das próximas sessões

Simulação sobre as operações já feitas, na ordem de saída, sem mudar preços. As regras de parada valem para o dia inteiro. Com poucos dias, não adote um filtro só porque melhorou o passado: trate como hipótese a testar.

Cenário operacional: próximas sessões



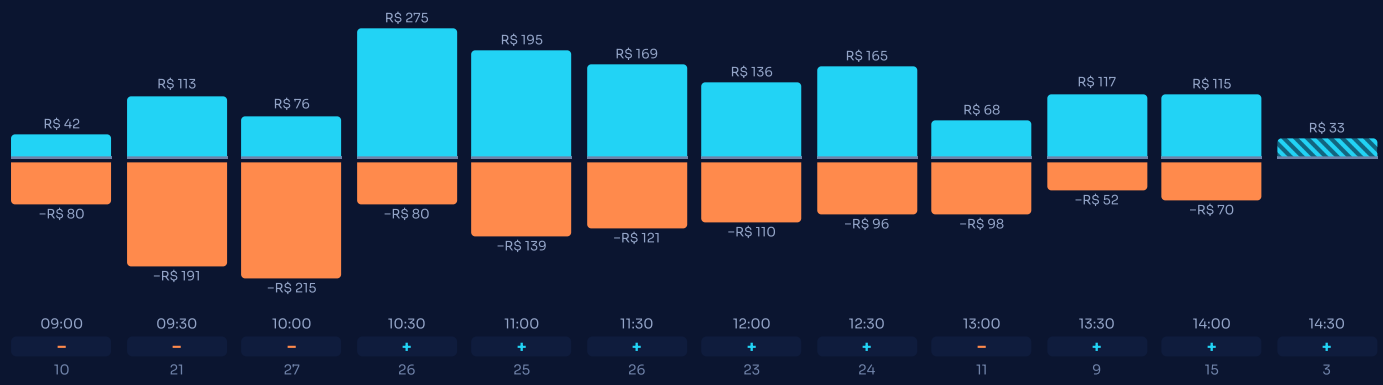
Chance de fechar no lucro	Resultado típico	Pior 5%	Drawdown em 95% dos casos até
98%	**R$ 839,00**	**R$ 174,00**	**R$ 367,00**
em 20 sessões	mediana	cenário ruim	mediana R$ 174,00

Sorteia dias inteiros do histórico (até os últimos 60 pregões, 6 dias). Descreve a amostra; não é previsão.

06 Onde está a vantagem

Horário, dia, ativo e direção: onde ganha e onde devolve.

Ganhos e perdas por faixa de horário (30 min, pela entrada)



Azul para cima = soma dos ganhos; laranja para baixo = soma das perdas; sinal = saldo; número = operações. Faixas com menos de 4 operações ficam tracejadas (amostra pequena). Clique numa faixa para ver as operações.

Melhor faixa	Pior faixa	Concentração das perdas	Depois de 15:00
10:30–11:00	**10:00–10:30**	**44%**	**nada**
saldo R$ 195,00 · 26 operações	saldo -R$ 139,00 · 27 operações	das perdas em 3 faixas de 30 min (10:00, 09:30, 11:00)	o saldo médio não cai depois do pico

Saldo médio ao longo do dia · onde o dia costuma ter o pico



Mapa de calor: hora × dia da semana

	9h	10h	11h	12h	13h	14h
seg	7	9	10			
ter	7	6	4	15	1	3
qua	4	9	9	11	9	5
qui	9	18	20	20	10	10
sex	4	11	8	1		

Cor = saldo líquido da janela (azul positivo, laranja negativo; mais forte = maior). Número = operações; tracejado = menos de 3.

Por ativo

WIN — R$ 252
220 op · 48% · payoff 1,29

Por direção

Venda — R$ 202
57 op · 60% · payoff 1,22

Compra — R$ 50
163 op · 44% · payoff 1,33

07 Comportamento e disciplina

Padrões de decisão que o histórico revela.

Depois de uma perda

Qualquer (2.ª em diante) — R$ 1,37
214 op · acerto 49%

Depois de um ganho — R$ 3,45
102 op · acerto 62%

Depois de 1 perda — -R$ 2,49
43 op · acerto 35%

Depois de 2+ perdas — R$ 0,71
69 op · acerto 39%

Resultado médio da operação seguinte no mesmo dia. Pior depois de perdas = sinal de operar por impulso (vingança).

Lote depois de perder

Lote fixo

Todas as operações com 1 contrato(s): sem sinal de aumentar a mão depois de perder.

Excesso de operações

1.ª do dia — -R$ 7,00
6 op · acerto 17%

2.ª do dia — -R$ 3,17
6 op · acerto 33%

3.ª do dia — -R$ 3,17
6 op · acerto 33%

4.ª do dia — R$ 1,83
6 op · acerto 50%

5.ª do dia — -R$ 8,17
6 op · acerto 17%

6.ª do dia — -R$ 8,00
6 op · acerto 17%

7.ª do dia — -R$ 3,00
6 op · acerto 33%

8.ª ou mais — R$ 2,45
178 op · acerto 53%

Resultado médio pela ordem da operação no dia: mostra a partir de qual operação o dia piora.

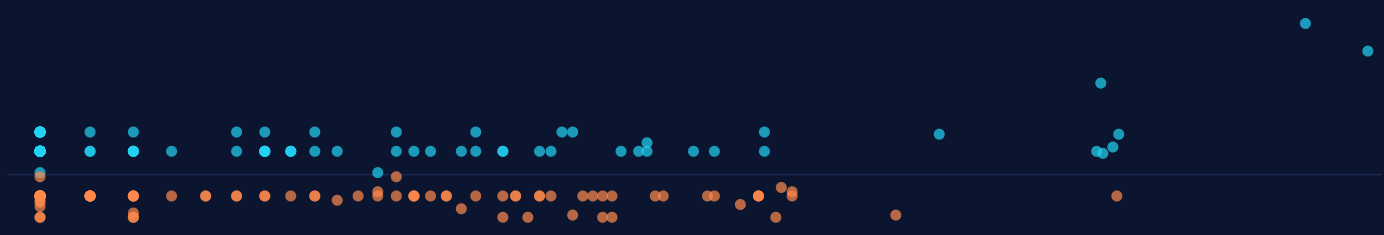
Dia que começou mal

Dia começou com perda
R$ 22,40
5 dias · 60% terminam positivos

Dia começou com ganho
R$ 140,00
1 dias · 100% terminam positivos

Resultado médio do dia inteiro conforme a 1.ª operação. Se o dia que começa mal raramente vira, uma regra de parada pode ser testada no simulador.

Corta o ganho cedo, segura a perda?



0,1 min — 6 min (escala log)

Mediana dos ganhos
0,1 min

Mediana das perdas
0,1 min

Ganhos e perdas com durações parecidas.

08 Risco caudal e dependência

O resultado depende de poucos trades?

Teste "sem os maiores ganhos"

Resultado completo	R$ 252,00
Sem o maior ganho	R$ 181,00
Sem os 3 maiores	R$ 80,00
Sem os 11 maiores (5%)	-R$ 80,00

O resultado resiste à retirada dos maiores ganhos.

Risco nas caudas

VaR 95% (histórico)
-R$ 18,00

CVaR 95% (média do pior 5%)
-R$ 19,67

Assimetria
0,92

Curtose em excesso
2,08

Cauda de ganhos: poucos ganhos grandes puxam o resultado.

09 Teste de regras de mesa proprietária

Digite as regras e veja onde o histórico teria parado.

Se este histórico fosse uma avaliação, teria respeitado as regras?

Perda diária máx. (R$): ex.: 500

Drawdown máx. (R$): ex.: 1500

Tipo de drawdown: Fixo (do saldo inicia

Meta de lucro (R$): ex.: 2000

Consistência (%): 30

Dias mínimos: ex.: 10

Regra	Limite	Seu histórico	Situação
Perda diária máxima	—	pior dia (mínimo intradiário) -R$ 172,00	defina o limite
Drawdown máximo (fixo, do saldo inicial)	—	drawdown do período R$ 192,00	defina o limite
Meta de lucro	—	resultado R$ 252,00	defina a meta
Consistência (melhor dia ≤ 30% do total)	30%	melhor dia = 56% do total	acima do limite
Dias mínimos operados	—	6 dias	defina o mínimo

Regras digitadas pelo trader. Mostra o dia exato em que cada limite teria sido violado; não avalia, não aprova e não garante aprovação em nenhuma mesa.

10 Plano de acompanhamento

O que observar até o próximo dossiê.

Metas para o próximo período

- Limitar sequências de perda: a maior foi de 9 seguidas.
- Reduzir a dependência do melhor dia (56% do total).
- Juntar mais 369 operações com o mesmo método antes de mudar a estratégia.
- Gerar um novo dossiê no fim do próximo período e comparar.

Identificação e metodologia

Identificador
DT-EXEMPLO

Operações apuradas
220

Registro de integridade dos dados (SHA-256 das operações apuradas)

`4416b81d3f87189d9e3a0aaa4b0fd7c6ae4e9c01a8448151b8694eafd57e20a8`

Os dados vêm do arquivo de ordens enviado por você e não são verificados de forma independente. Operações pareadas por ordem de execução (FIFO), com o valor do ponto e o custo por contrato indicados. Simulações sorteiam dias inteiros do próprio histórico: descrevem a amostra, não preveem resultados.

O Report Lab não é analista nem consultor de valores mobiliários registrado na CVM. O dossiê descreve o histórico enviado; não indica ativos, não sugere tamanho de posição e não promete resultados. Calculado neste navegador: o arquivo não foi enviado ao servidor.