Blinq *Assimétrico I*

ESTRATÉGIA QUANTITATIVA · PERFIL DE NEUTRO AO MERCADO · USD

+21.49%	+24.49%	3.47%	-1.25%	5.20
RETORNO NO ANO	ANUALIZADO	VOLATILIDADE	DRAWDOWN MÁX.	SHARPE

OBJETIVO E ESTRATÉGIA

O **Blinq Assimétrico I** busca um retorno que não acompanha o mercado, por meio de estratégias sistemáticas em ações, ETFs e derivativos de alta liquidez, combinadas para que o conjunto tenha correlação próxima de zero com o índice, de modo que o resultado não dependa de o mercado subir ou cair.

A carteira combina estratégias independentes, cada uma com modelos estatísticos e resultado próprios. Toda posição nasce com a perda máxima definida e com o tamanho em proporção do patrimônio.

Nenhuma decisão é discricionária: os modelos decidem, a plataforma proprietária da Blinq executa e seis controles de risco automáticos limitam cada operação e a carteira; a perda no pregão, o risco de gap e a margem são medidos minuto a minuto, e o drawdown a cada fechamento.

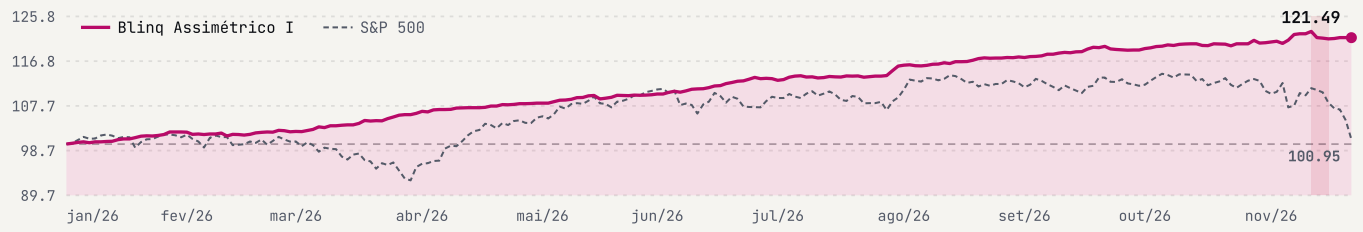
POR QUE O ASSIMÉTRICO I

- **10 de 10** meses positivos desde o início, com o pior mês em **+0.03% (fev/2026)**.
- Perda máxima conhecida em cada posição; o pior dia possível é um número, não uma surpresa.

CARACTERÍSTICAS DA ESTRATÉGIA

Empresa	Blinq Capital
Tipo	Quantitativa multiestratégia
Perfil	Neutro ao mercado
Mercados	Ações, ETFs e derivativos
Moeda	USD
Início da série	02/01/2026
Horizonte	Intradiário
Clientes	Bancos, fundos, gestoras e family offices
Execução	Automatizada · conectada via FIX ou API
Contato	info@blinq.capital

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO · BASE 100 · 02/01/2026 A 20/11/2026



Patrimônio diário em base 100, líquido de custos de corretagem, e o S&P 500 na mesma base (fechamento diário, sem dividendos); a área sombreada marca o maior drawdown do período.

DESEMPENHO E RISCO

RETORNO NO ANO +21.49% 224 pregões	RETORNO ANUALIZADO +24.49% composto, 252 pregões	VOLATILIDADE ANUALIZADA 3.47% desvio dos retornos diários	ÍNDICE DE SHARPE 5.20 sobre a taxa livre de risco
DRAWDOWN MÁXIMO -1.25% 11/11/2026 a 16/11/2026	PIOR TICK INTRADIÁRIO -1.16% 17/02/2026	VAR 99% DIÁRIO -0.57% histórico, 1 dia	RISCO DE GAP -4.48% choque simultâneo, valor intrínseco
MÊS MÉDIO +1.79% 10 de 10 meses positivos	MELHOR MÊS +3.64% mar/2026	PIOR MÊS +0.03% fev/2026	PREGÕES POSITIVOS 69.6% 64 pregões negativos

RENTABILIDADE MENSAL · % SOBRE O PATRIMÔNIO DE ABERTURA DO MÊS

ANO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2026	+2.46%	+0.03%	+3.64%	+1.92%	+1.57%	+2.96%	+2.23%	+1.62%	+1.20%	+1.22%	+0.85%*	·	+21.49%

* mês em curso, incompleto. Rentabilidade líquida de custos de corretagem.

SEIS CONTROLES DE RISCO

- **Perda máxima definida**: toda venda de opção nasce junto com a compra que limita a perda.
- **Limite de risco por operação**: cada entrada tem um teto de risco, em proporção do patrimônio.
- **Stop loss**: as regras que usam stop encerram a posição quando a perda atinge o limite delas.
- **Limite de perda por período**: perdas acumuladas no período suspendem novas entradas.
- **Limite de exposição da carteira**: a exposição somada de todas as posições tem um teto, em proporção do patrimônio.
- **Monitoramento e teste de estresse**: a perda no pregão, a margem e o risco de gap (o mesmo cálculo de um teste de estresse) são medidos minuto a minuto, na simulação e em cada pregão ao vivo refeito nela.

PROCESSO DE INVESTIMENTO

01	02	03	04
Dados	**Pesquisa**	**Validação**	**Execução e controle**
Cotações, livros de ofertas, cadeias de opções, volatilidade e calendário.	Hipótese declarada antes de medir; em cada minuto simulado, só o que já tinha sido publicado naquele instante.	Simulação minuto a minuto com o mesmo código do pregão, executada no bid e no ask, com custos. Só avança se cumprir os critérios de aceitação.	Ordens automatizadas via FIX ou API, cada posição inteira numa única ordem; qualquer divergência investigada antes do pregão seguinte.

SOBRE A BLINQ CAPITAL

A Blinq Capital é uma empresa de tecnologia quantitativa construída sobre uma plataforma proprietária, desenvolvida internamente para pesquisar, validar e operar estratégias de investimento. Cada etapa é documentada, auditável e reproduzível: qualquer decisão pode ser refeita, a qualquer tempo, exatamente como foi tomada. As estratégias da Blinq atendem bancos, fundos de investimento, gestoras e family offices, em perfis distintos: retorno absoluto, baixa volatilidade ou neutro ao mercado.

GLOSSÁRIO

Drawdown máximo: maior queda de um fechamento máximo até o fechamento mais baixo seguinte.

Pior tick: menor marcação intradiária do patrimônio contra o fechamento anterior.

Risco de gap: perda da carteira se todos os ativos saltassem juntos pela faixa de estresse, com cada opção no valor intrínseco.

VaR 99%: perda diária que só 1% dos pregões do período superou.

INFORMAÇÕES IMPORTANTES

Este material é de uso exclusivamente informativo, destinado a bancos, fundos de investimento, gestoras e family offices, e não constitui oferta, recomendação ou solicitação de compra ou venda de qualquer ativo, nem aconselhamento de investimento. Os resultados apresentados são os registrados pela plataforma da Blinq Capital, pregão a pregão, líquidos de custos de corretagem; rentabilidade passada não garante rentabilidade futura.

Indicadores calculados sobre a série diária do patrimônio em base 100: retorno anualizado composto sobre 252 pregões; volatilidade como desvio-padrão dos retornos diários anualizado; Sharpe líquido da taxa livre de risco; meses negativos contados só sobre meses inteiros.