

Relatório de Desempenho da Carteira

KPIs - Carteira Otimizada

Nome: Carteira

Retorno Anual (%): 27.11

Volatilidade Anual (%): 25.11

Sharpe Ratio: 1.02

Sortino Ratio: 6.864

Max Drawdown (%): 36.32

KPIs - Benchmark (S&P 500)

Nome: S&P 500

Retorno Anual (%): 13.85

Volatilidade Anual (%): 19.48

Sharpe Ratio: 0.634

Sortino Ratio: 3.857

Max Drawdown (%): 23.93

