



## Criação de Portfólio

### Relatório de Análise de Ativos Financeiros

Desenvolvido por William Brandão

Data:2025-05-01

O projeto teve como objetivo desenvolver uma estratégia quantitativa para análise e seleção de ativos financeiros listados no mercado brasileiro, utilizando métodos estatísticos e analíticos. A abordagem incluiu desde a coleta de dados via web scraping até a análise de desempenho de portfólios, com foco em métricas como Sharpe Ratio, Tracking Error, Drawdowns, e retornos acumulados.

#### 1. Gráfico de Evolução do Portfólio e dos Benchmark's

#### 2. Gráfico de Retorno Diário

#### 3. Gráfico de Percentual Acumulado

#### 4. Gráfico de Drawdowns



## Criação de Portfólio

**5. Gráfico de Drawdown Máximo**

**6. Gráfico de Sharpe Ratio**

**7. Gráfico de Taxa de Acerto**

**8. Gráfico de Tracking Error**

**9. Gráfico de Matriz de Correlação**



## Criação de Portfólio

### 10. Gráfico de Risco x Retorno