



# Relatório de Desenvolvimento do Projeto

*Data: 05/05/2025*

*Autor: William Brandão*

*Contato: williambrandao@outlook.com*

## Relatório Final do Projeto de Estratégia Quantitativa

Este relatório apresenta o desenvolvimento de uma estratégia quantitativa para análise e seleção de ativos financeiros listados no mercado brasileiro. O projeto utilizou métodos estatísticos e analíticos para criar um portfólio otimizado, com foco em métricas de risco-retorno, rebalanceamento e impacto de dividendos.

### Metodologia

A metodologia do projeto foi dividida em várias etapas, incluindo:

1. Coleta de dados via web scraping e APIs financeiras.
2. Análise de métricas como Sharpe Ratio, Tracking Error, Drawdowns e volatilidade.
3. Simulação de rebalanceamento anual do portfólio.
4. Comparação com benchmarks como Ibovespa, Small Caps, IFIX e CDI.
5. Visualizações interativas para análise de desempenho.
6. Geração de relatórios analíticos e comparativos.

### Resultados Obtidos

Os principais resultados obtidos durante o projeto incluem:

- Retorno acumulado do portfólio: mais de 600%.
- Volatilidade anualizada: 20.70%.
- Índice Sharpe: 1.13.
- Tracking Error em relação ao Ibovespa: 15.38%.
- Impacto dos dividendos: aumento significativo no retorno acumulado.
- Taxa de acerto do portfólio: 53.22%.



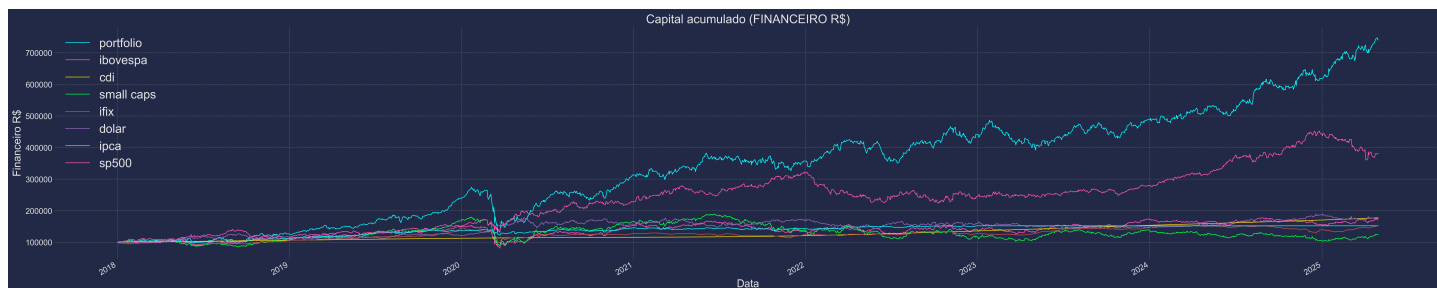
# Relatório de Desenvolvimento do Projeto

Data: 05/05/2025

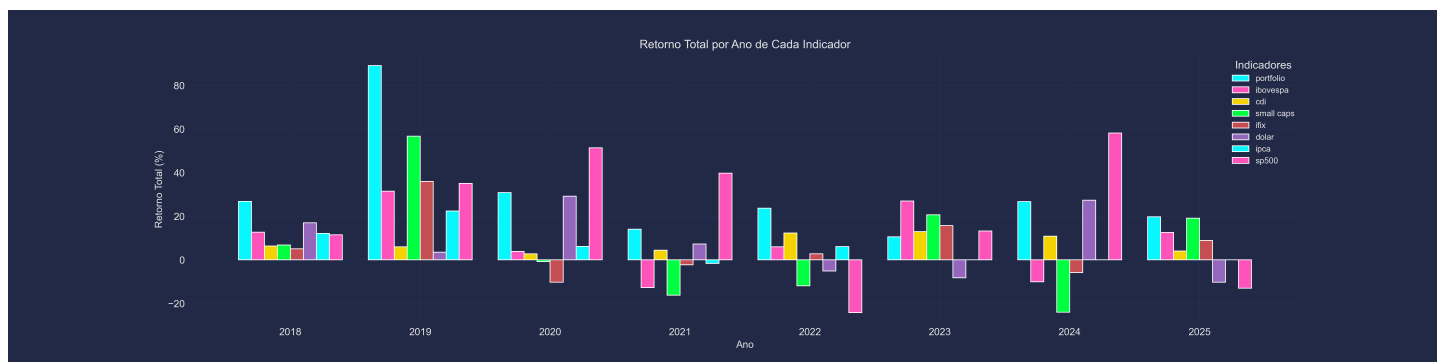
Autor: William Brandão

Contato: [williambrandao@outlook.com](mailto:williambrandao@outlook.com)

## Evolução do Portfólio e Benchmarks



## Retorno Total por Ano de Cada Indicador





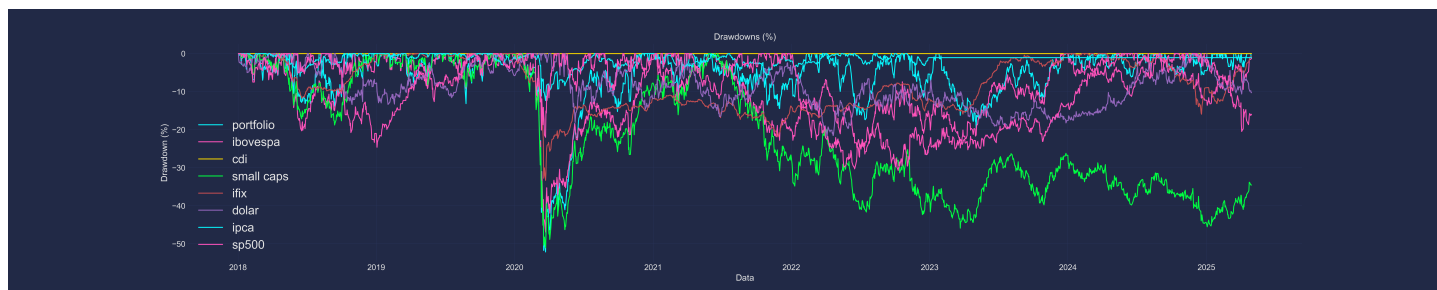
# Relatório de Desenvolvimento do Projeto

Data: 05/05/2025

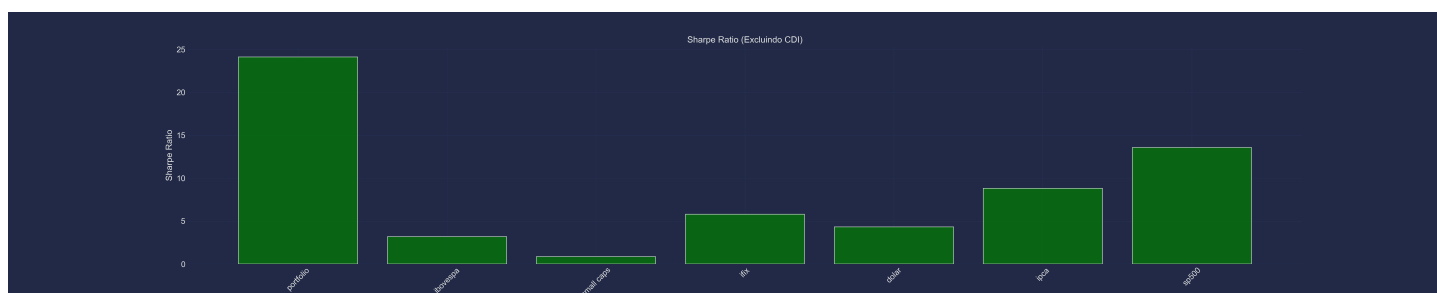
Autor: William Brandão

Contato: [williambrandao@outlook.com](mailto:williambrandao@outlook.com)

## Drawdowns Máximos



## Sharpe Ratio por Indicador





# Relatório de Desenvolvimento do Projeto

Data: 05/05/2025

Autor: William Brandão

Contato: williambrandao@outlook.com

## Taxa de Acerto por Indicador



## Tracking Error por Indicador





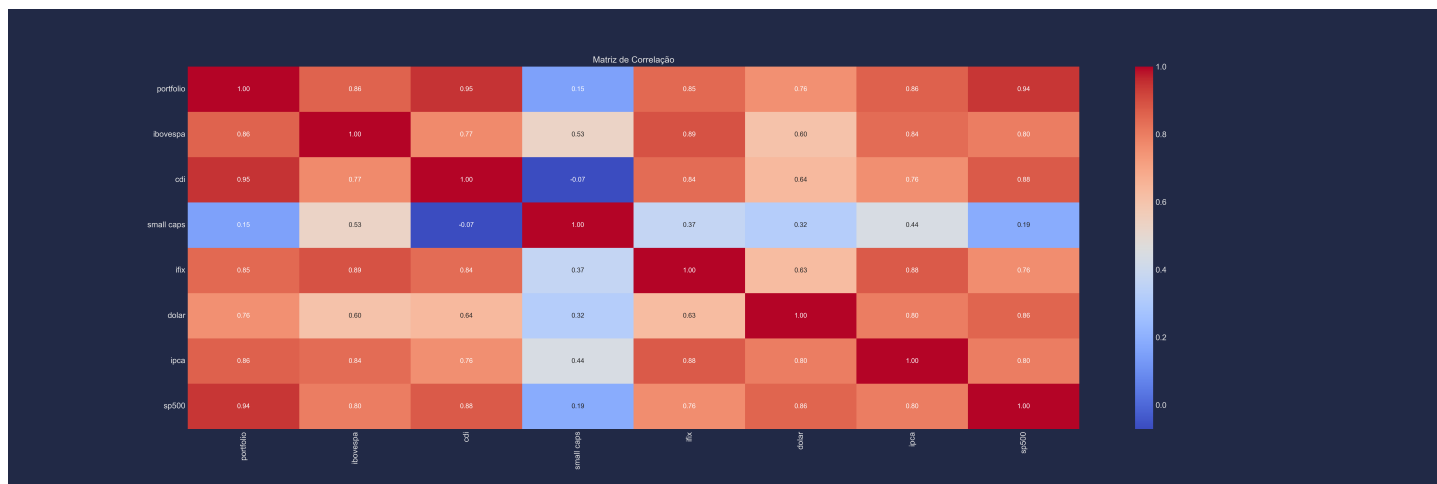
# Relatório de Desenvolvimento do Projeto

Data: 05/05/2025

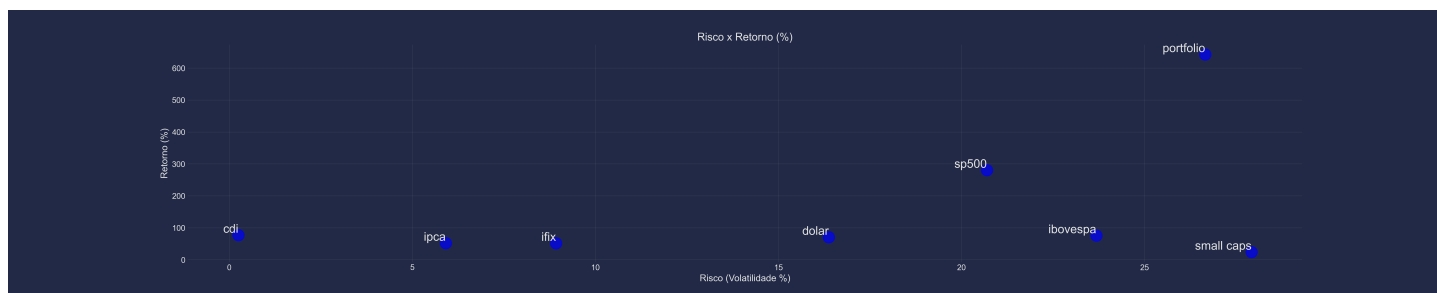
Autor: William Brandão

Contato: williambrandao@outlook.com

## Matriz de Correlação



## Comparativo Risco x Retorno





## Relatório de Desenvolvimento do Projeto

*Data: 05/05/2025*

*Autor: William Brandão*

*Contato: williambrandao@outlook.com*

### Conclusão

O projeto demonstrou a viabilidade de uma estratégia quantitativa para seleção e gestão de portfólios no mercado financeiro brasileiro. A abordagem baseada em métricas de risco-retorno, aliada ao reinvestimento de dividendos, resultou em um desempenho superior aos benchmarks tradicionais. Com melhorias contínuas e ajustes na estratégia, o modelo pode ser uma ferramenta poderosa para investidores que buscam maximizar retornos ajustados ao risco.

*Relatório gerado em: 05/05/2025 23:07:04*