

Portfólios Baseados em Dados

INSTRUÇÕES DE USO:

- 1 - Informe seu nome e melhor e-mail (e teclae TAB).
- 2 - Escolha o Tipo de Ativo a partir da lista suspensa (e teclae TAB).
- 3 - Selecione os Ativos a partir da lista (clique a seta antes de digitar).
- 4 - Confirme suas escolhas.
- 5 - Se houver mensagem de alerta, substitua o ativo.
- 6 - Para sair do App basta fechar o navegador.

Indicadores do Portfólio (em Beta Teste)

	Renda Fixa com Buy&Hold	Apenas Buy&Hold
Data Inicial	2019-06-02	2019-06-02
Data Final	2021-10-13	2021-10-13
Tx. Livre de Risco (% aa.)	4.86	4.86
Retorno Total (% no periodo)	-0.00	-1.00
CAGR (% aa.)	-0.00	-0.00
Índice de Shazpe Anualizado	-306.06	-199.87
Queda Máxima (% aa.)	-30.00	-31.00
Dias de Queda	60.62	60.62
Rentab. Melhor Mês (% aa.)	12.55	12.70
Rentab. Pior Mês (% aa.)	-10.84	-11.08

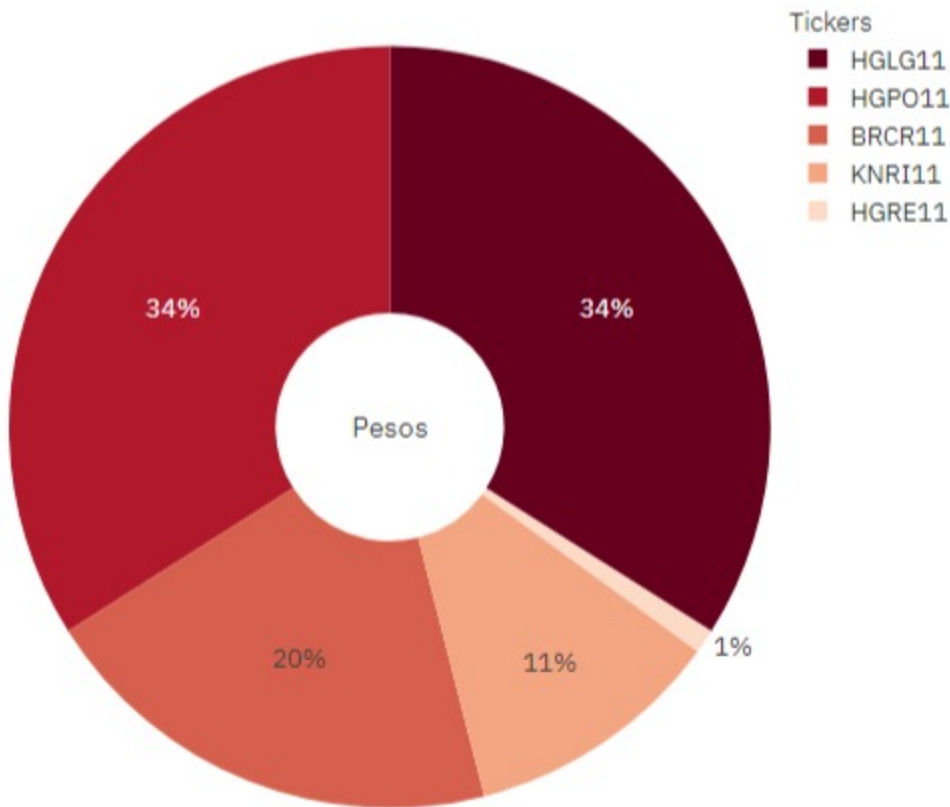
Gráfico comparativo dos Ativos do Portfólio

Ativos escolhidos e o IFIX



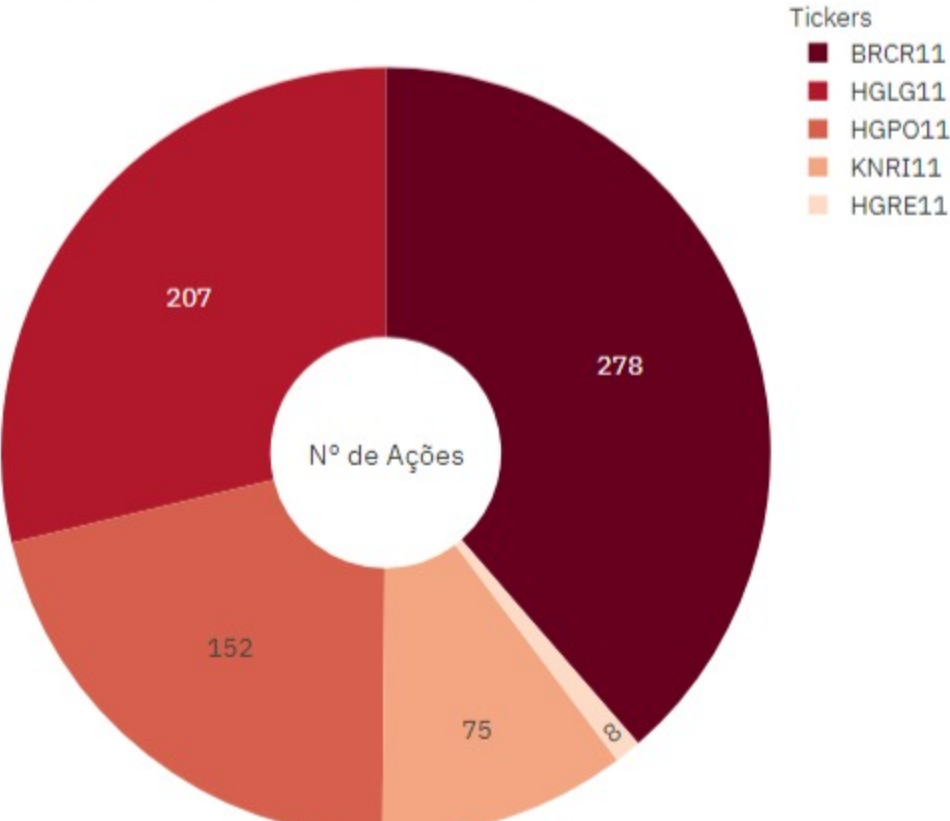
Pesos Percentuais para o Portfólio de Máx. Índice de Sharpe

Alocação % - Máximo Índice de Sharpe



Quantidades de Ações/Cotas para o Portfólio de Máx. Índice de Sharpe

Alocação em Qtdes. de Ações por \$100 mil

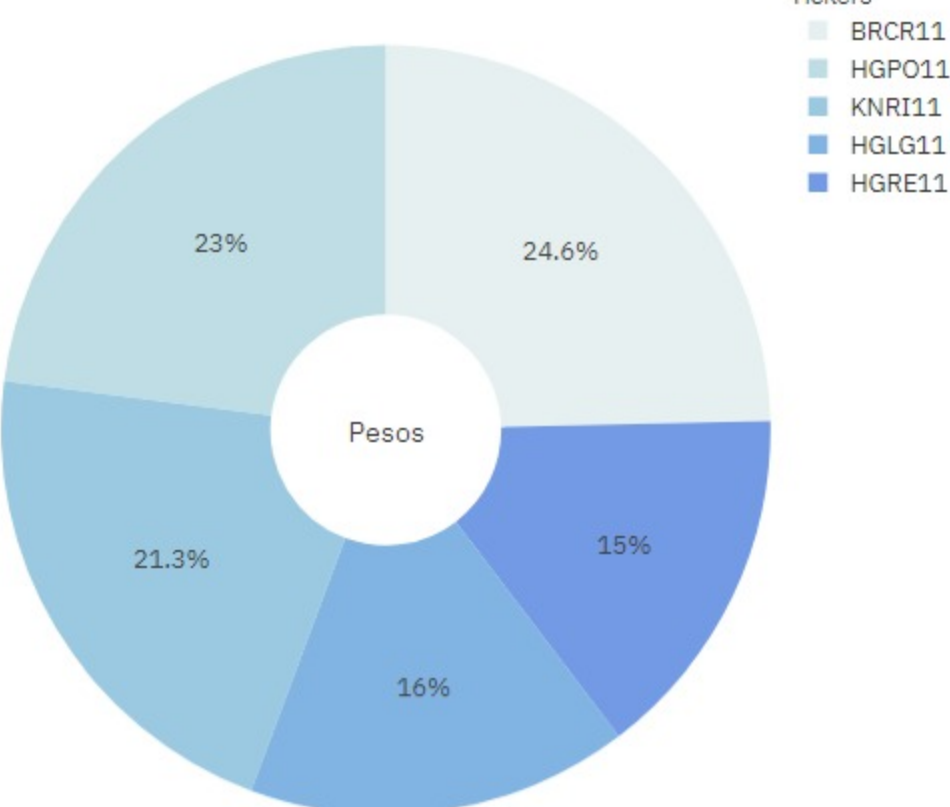


Performance Portfólio de Máx. Índice de Sharpe

Retorno Anual Esperado: 1.9%
Volatilidade Anual: 15.7%
Índice de SHARPE: -0.01

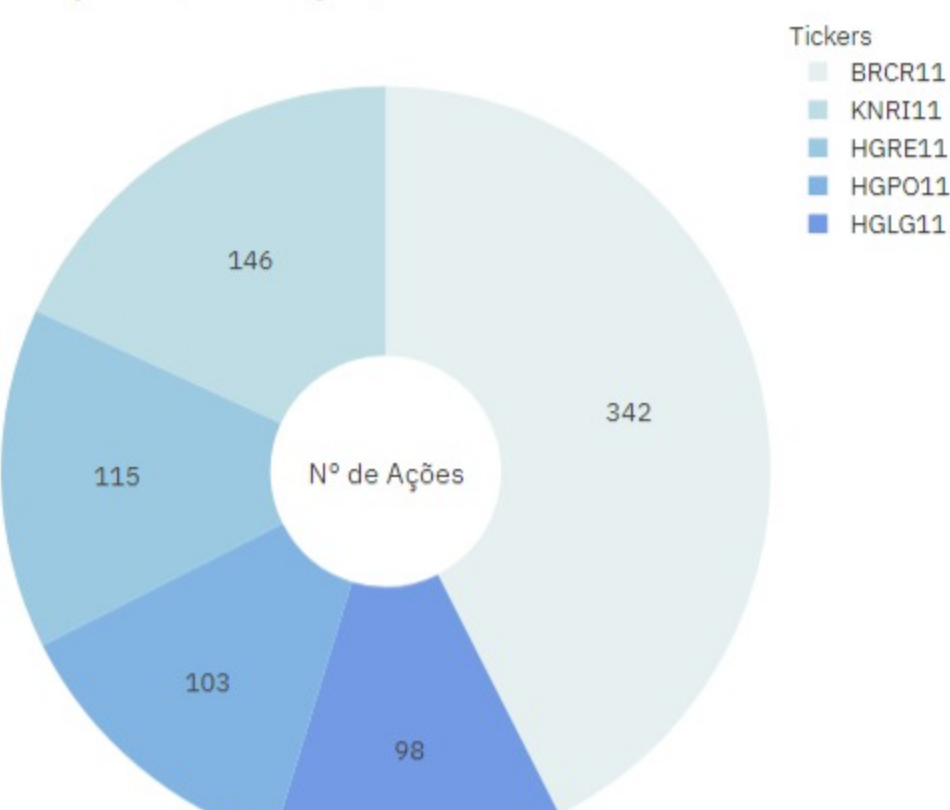
Pesos Percentuais para o Portfólio de Variância Mínima

Alocação % - Volatilidade Mínima (Histórica)



Quantidades de Ações/Cotas para o Portfólio de Variância Mínima

Alocação em Qtdes. de Ações por \$100 mil

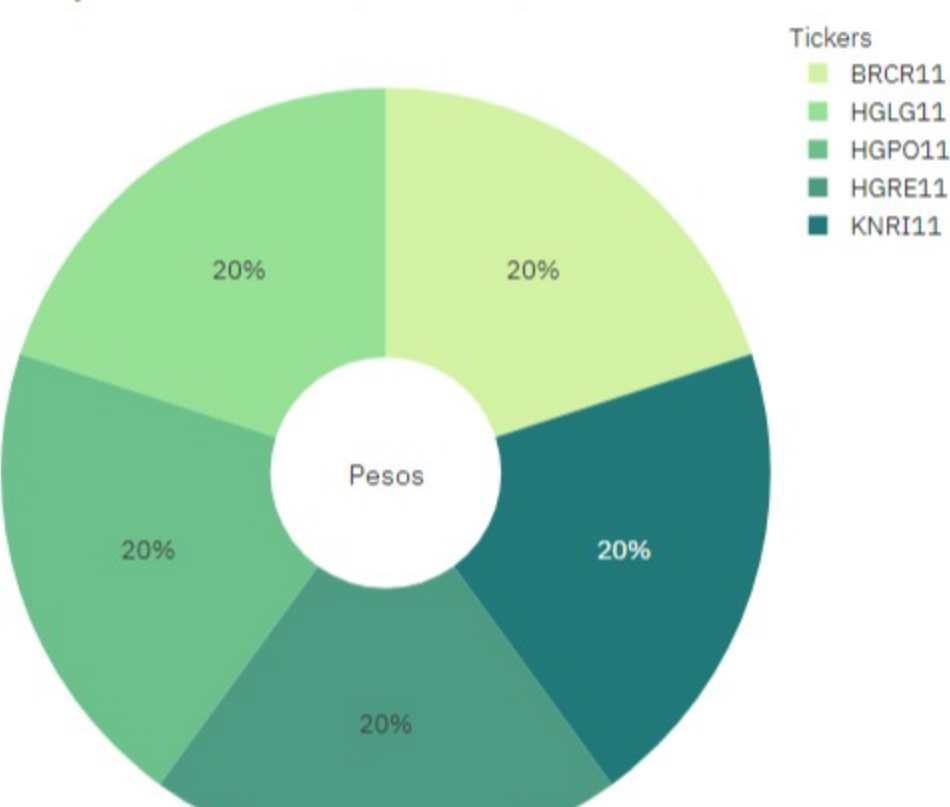


Performance Portfólio de Variância Mínima

Retorno Anual Esperado: -1.2%
Volatilidade Anual: 15.0%
Índice de SHARPE: -0.22

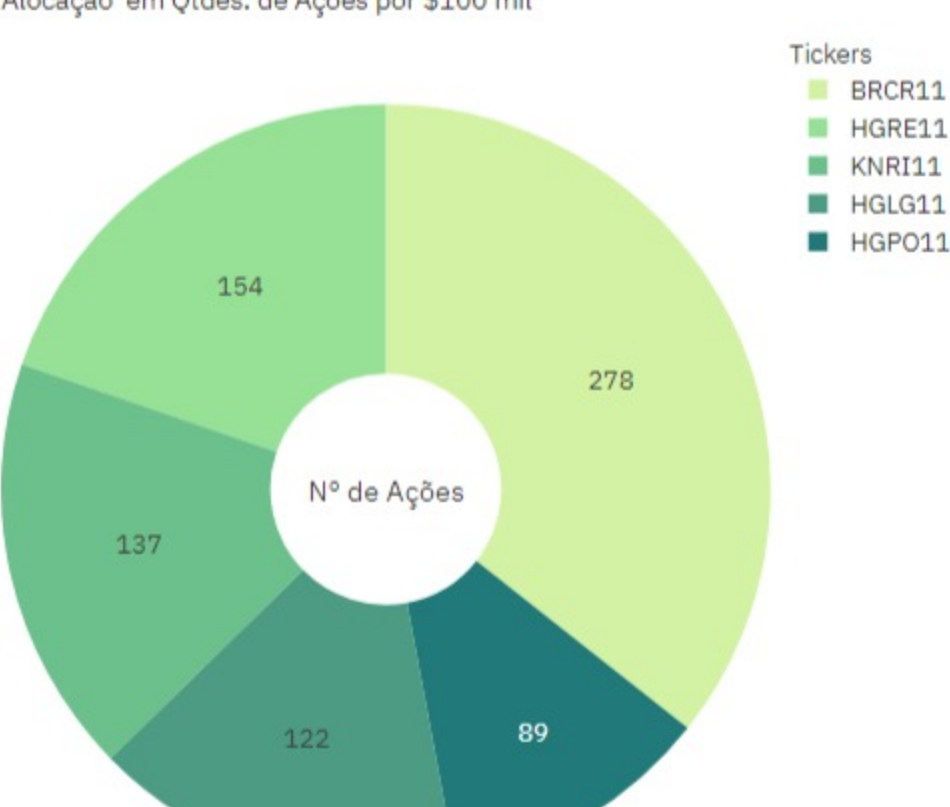
Pesos Percentuais para o Portfólio de Risco Máx. Tolerado

Alocação % - Risco Máximo (default=20%)



Quantidades de Ações/Cotas para o Portfólio de Risco Máx. Tolerado

Alocação em Qtdes. de Ações por \$100 mil



Performance Portfólio de Risco Máximo Tolerado

Retorno Anual Esperado: -1.4%
Volatilidade Anual: 15.6%
Índice de SHARPE: -0.22

Visualização da Fronteira Eficiente para o Portfólio Escolhido

