código.py

Relatório do Modelo

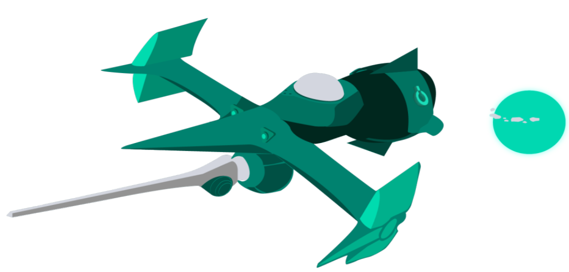
Dia inicial	2012-03-08
Dia final	2021-04-16
Dias totais	2251

Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	327.65%
Retorno acum. ativo	15.93%
Retorno acum. CDI	110.86%
Retorno acum. IBOV	83.46%
Retorno a.a. modelo	17.67%
Vol 252d	48.47%
Índice Sharpe	0.18
VAR diário 95%	-4.72%
Drawdown máximo	-67.07%

Estatísticas de Trade

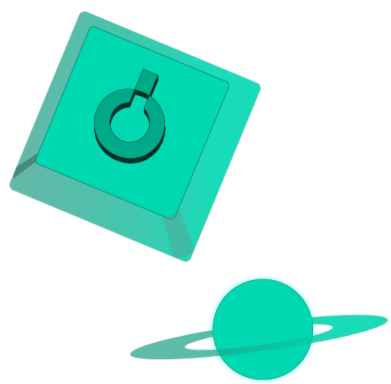
Número de trades	172
% Operações vencedoras	36.63%
% Operações perdedoras	63.37%
Média de ganhos	12.26%
Média de perdas	-4.87%
Expec. matemática por trade	1.41%
Tempo médio de operação	13
Maior sequência de vitória	4
Maior sequência de derrotas	12

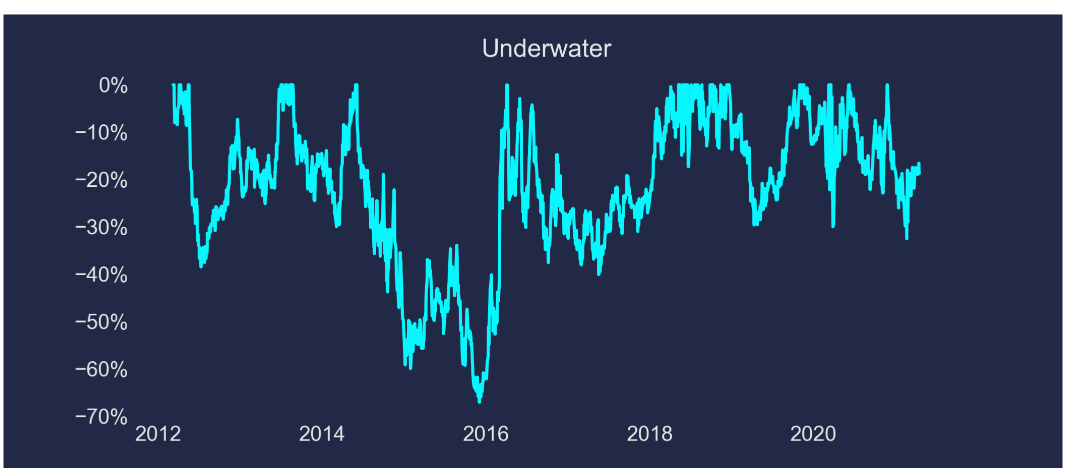


Relatório do Modelo

Eventos de estresse

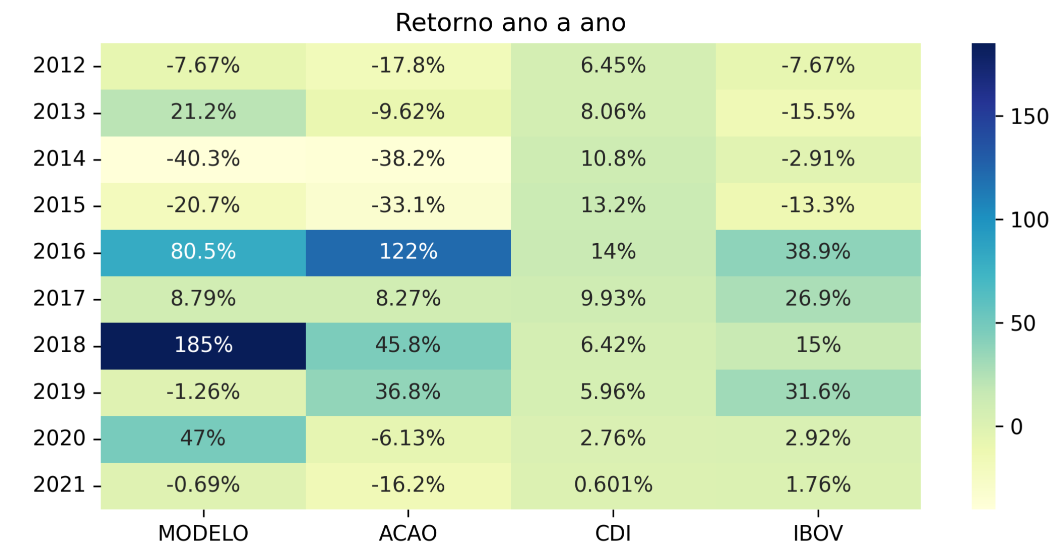
Joesley Day - 18/05/2017	-15.76%
Auge pandemia: Março - 2020	33.8%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	12.29%
Precatórios - ago/nov 2021	-
Crise de 2008	-

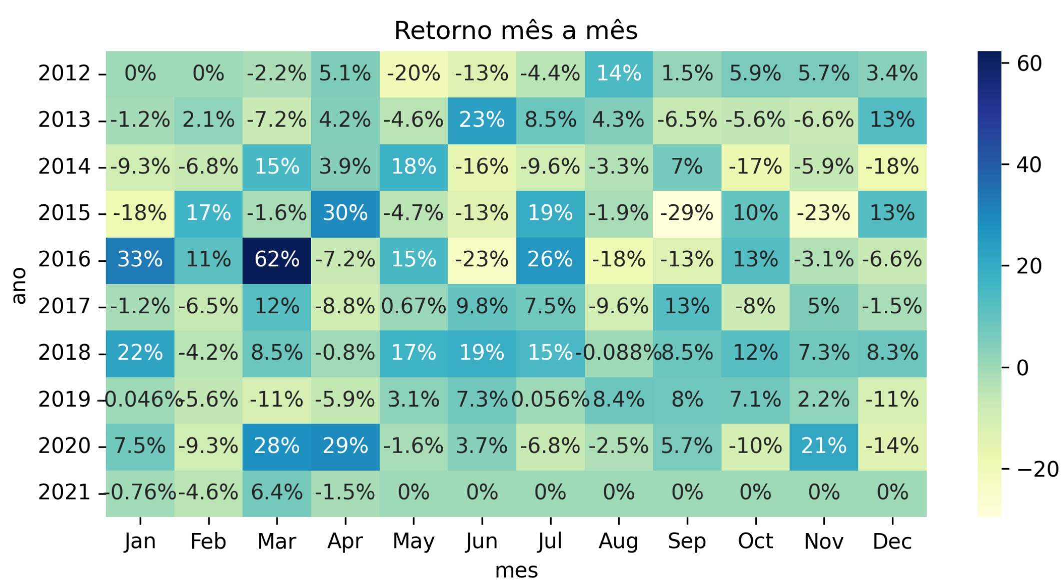




código.py

Relatório do Modelo





códigо.py

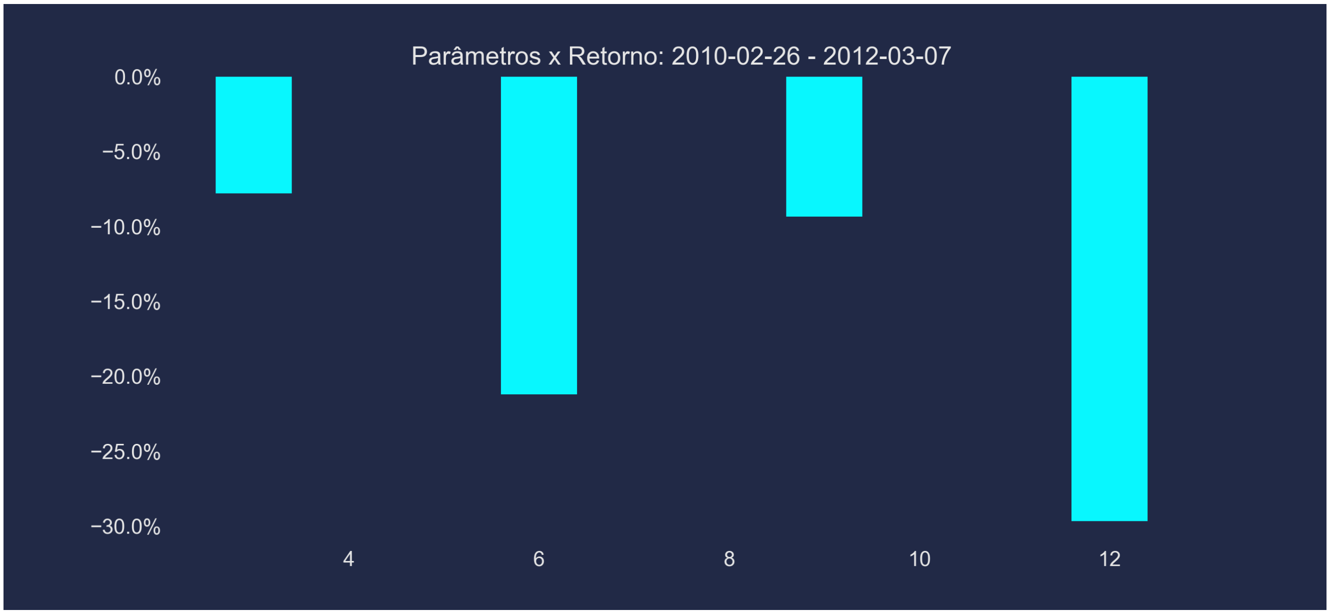
Relatório do Modelo

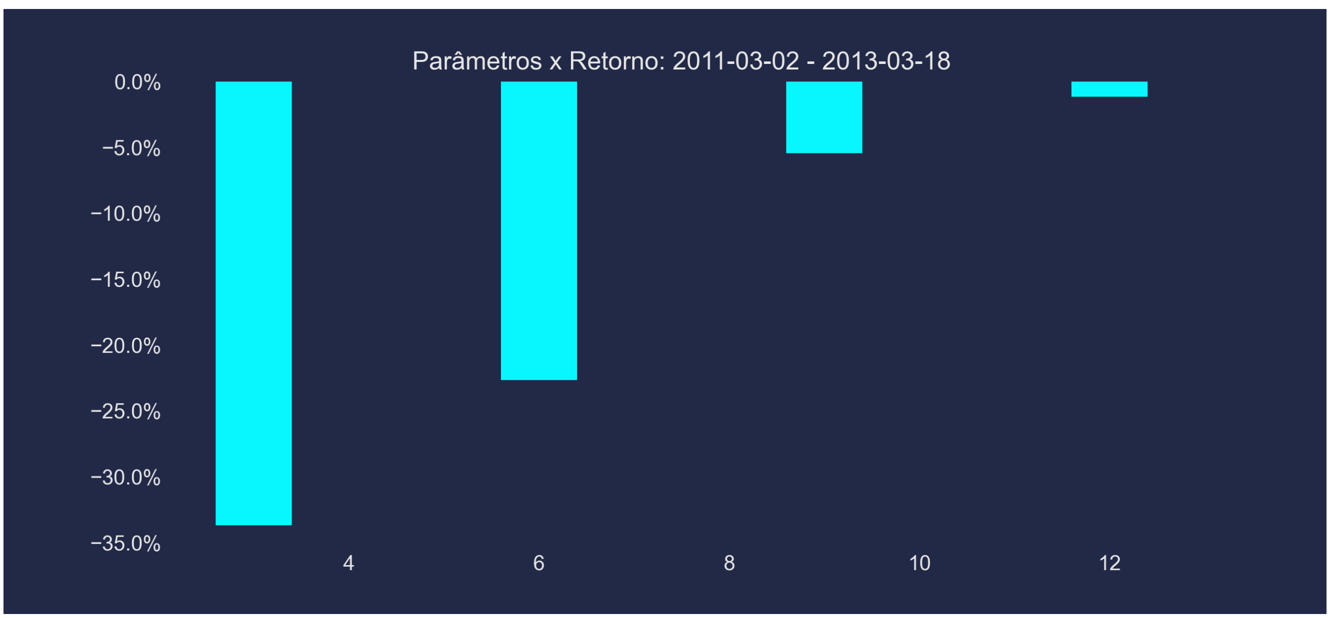
Tabela resultados otimização

Data inicial IS	Data final IS	Retorno IS a.m.	Data inicial OOS	Data final OOS	Retorno OOS a.m.	Parâmetro 1	Parâmetro 2
2010-02-26	2012-03-07	-0.34%	2012-03-08	2013-03-18	-0.82%	3	None
2011-03-02	2013-03-18	-0.05%	2013-03-19	2014-03-21	0.55%	12	None
2012-03-07	2014-03-21	1.17%	2014-03-24	2015-03-27	-3.83%	12	None
2013-03-18	2015-03-27	-1.37%	2015-03-30	2016-04-07	7.07%	9	None
2014-03-21	2016-04-07	1.78%	2016-04-08	2017-04-10	-2.45%	9	None
2015-03-27	2017-04-10	2.19%	2017-04-11	2018-04-19	1.83%	9	None
2016-04-07	2018-04-19	-0.33%	2018-04-20	2019-04-30	5.21%	9	None
2017-04-10	2019-04-30	3.5%	2019-05-02	2020-05-06	5.63%	9	None
2018-04-19	2020-05-06	6.17%	2020-05-07	2021-04-16	-0.46%	3	None

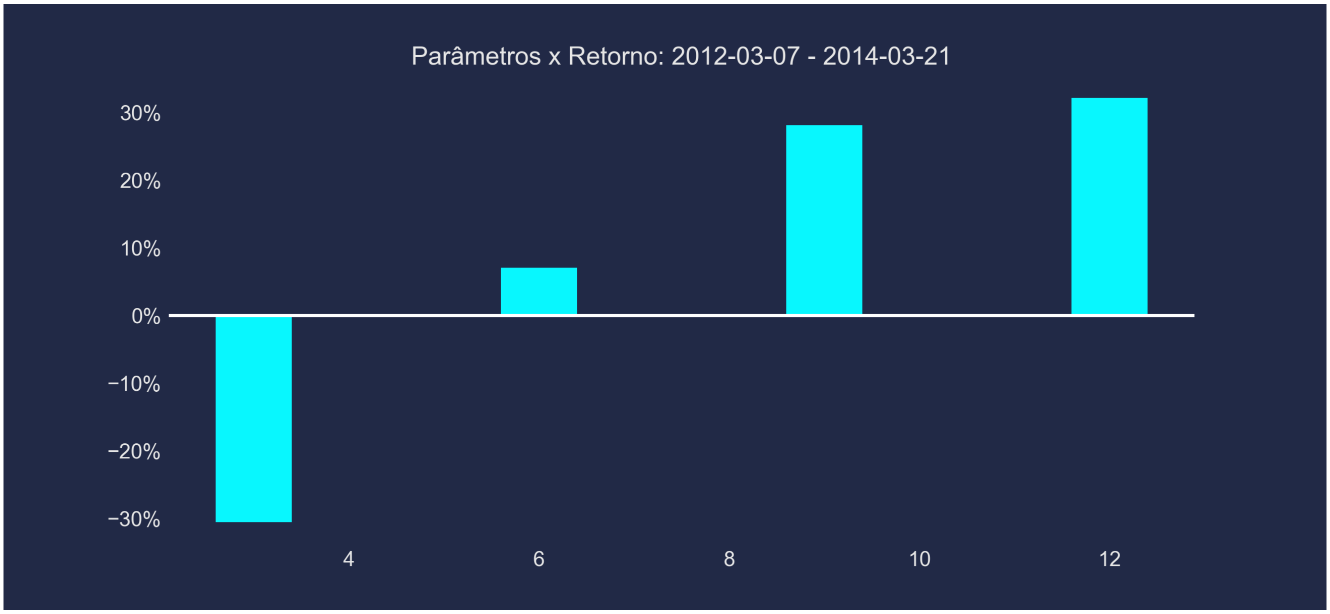
Retono médio IS	Retorno médio OOS
1.41%	**1.41%**

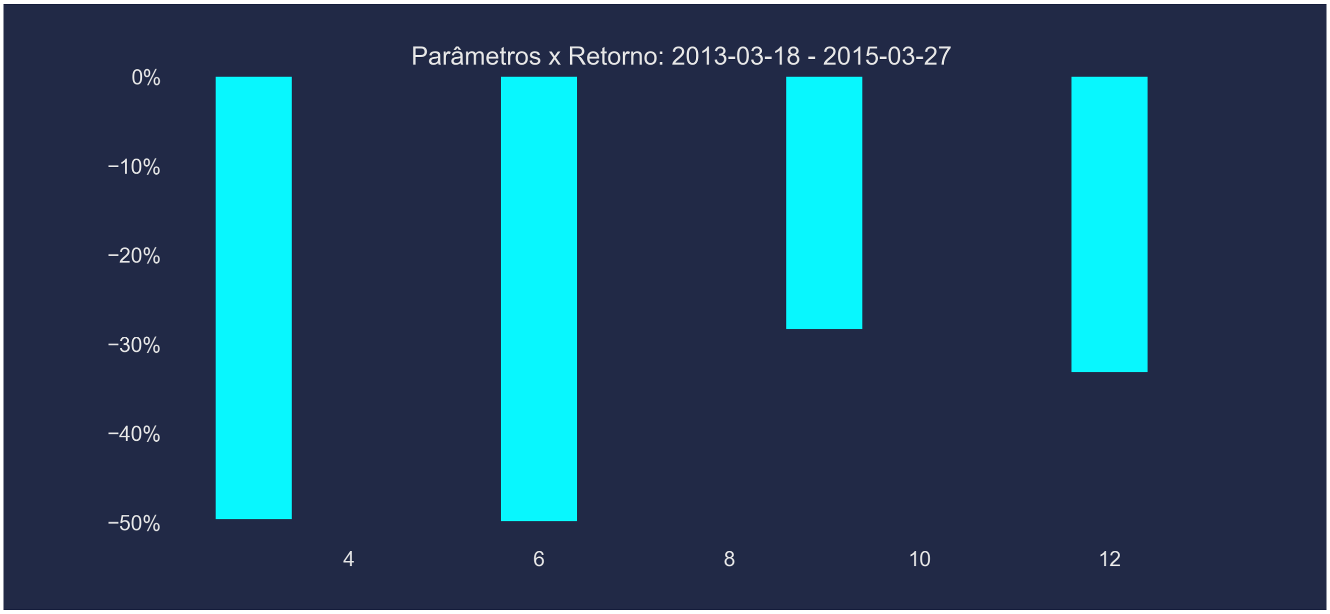
Relatório do Modelo



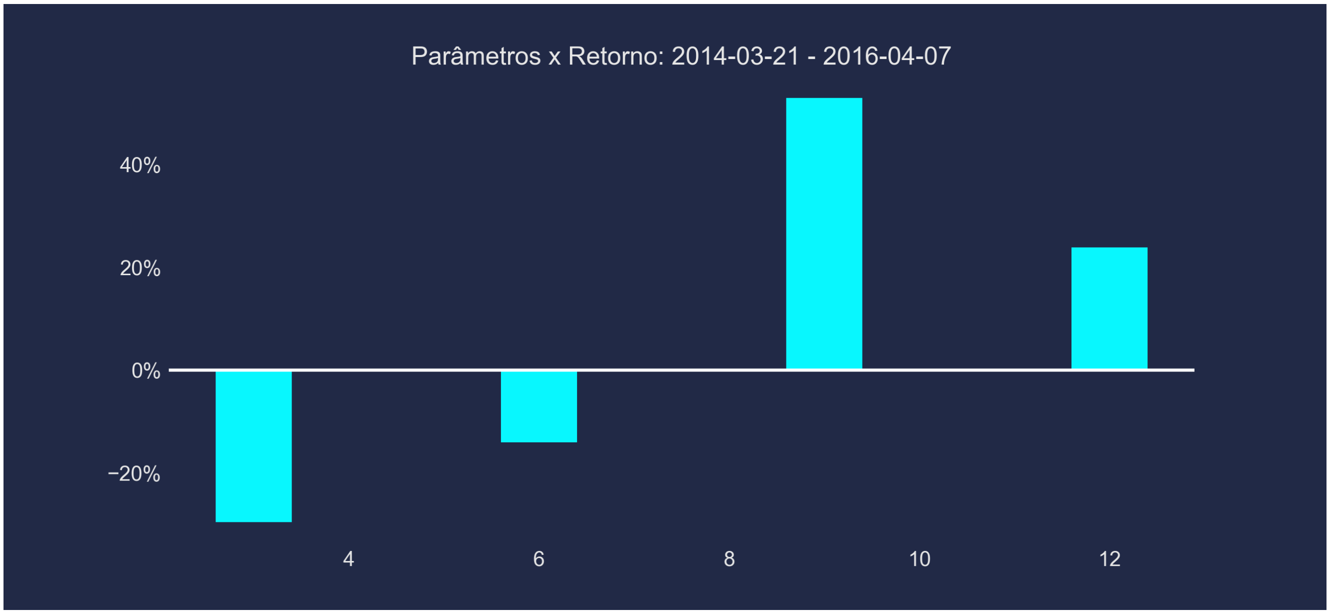


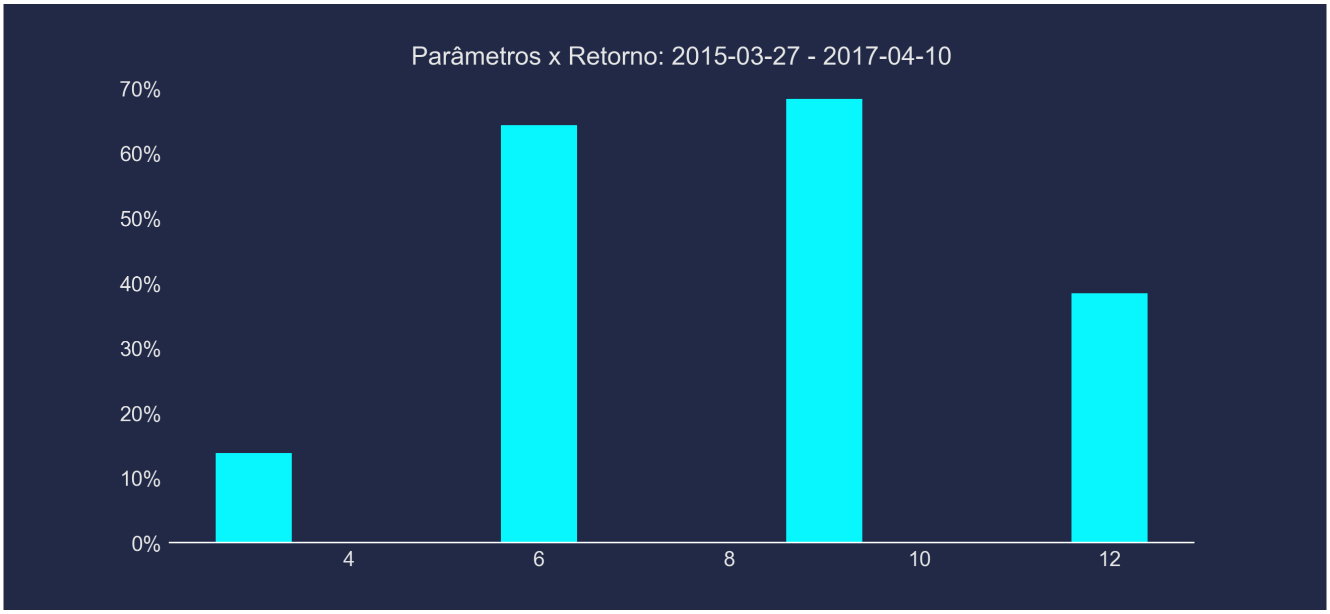
Relatório do Modelo





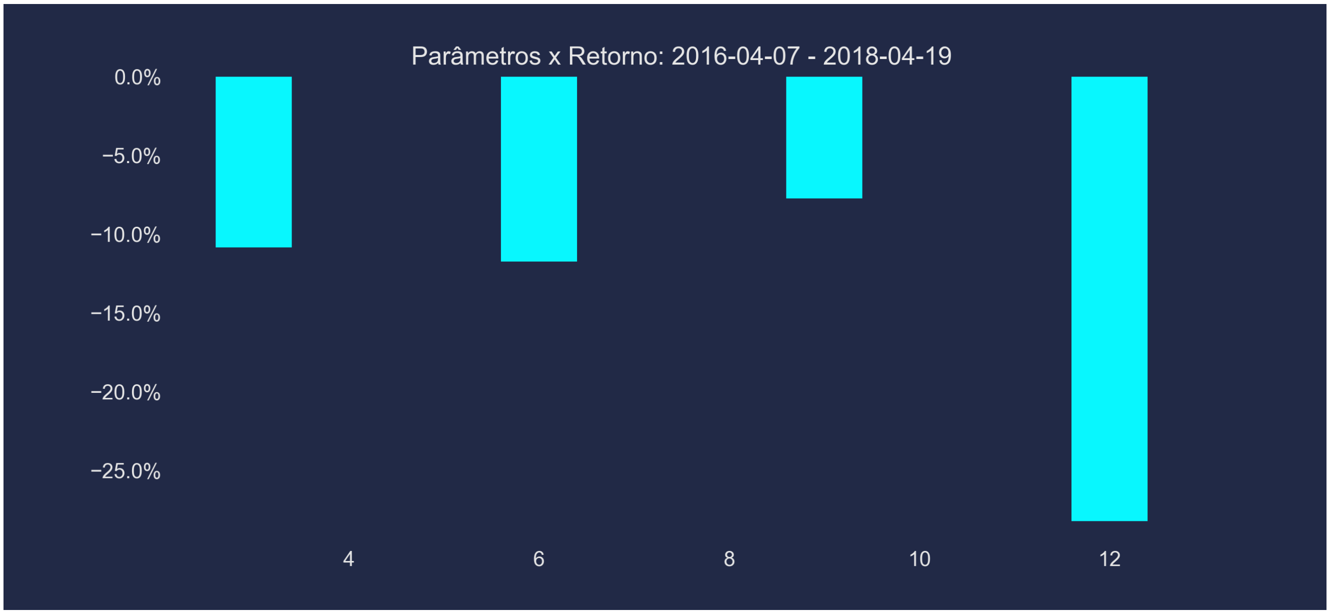
Relatório do Modelo

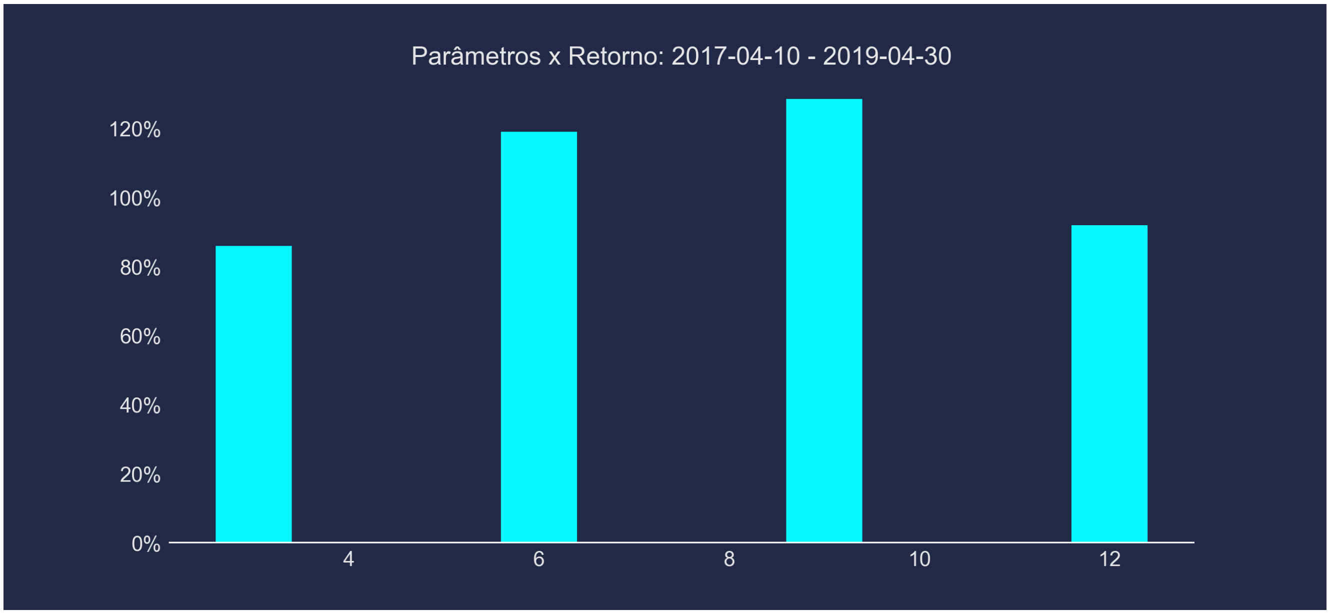




cōdigo.py

Relatório do Modelo





Relatório do Modelo