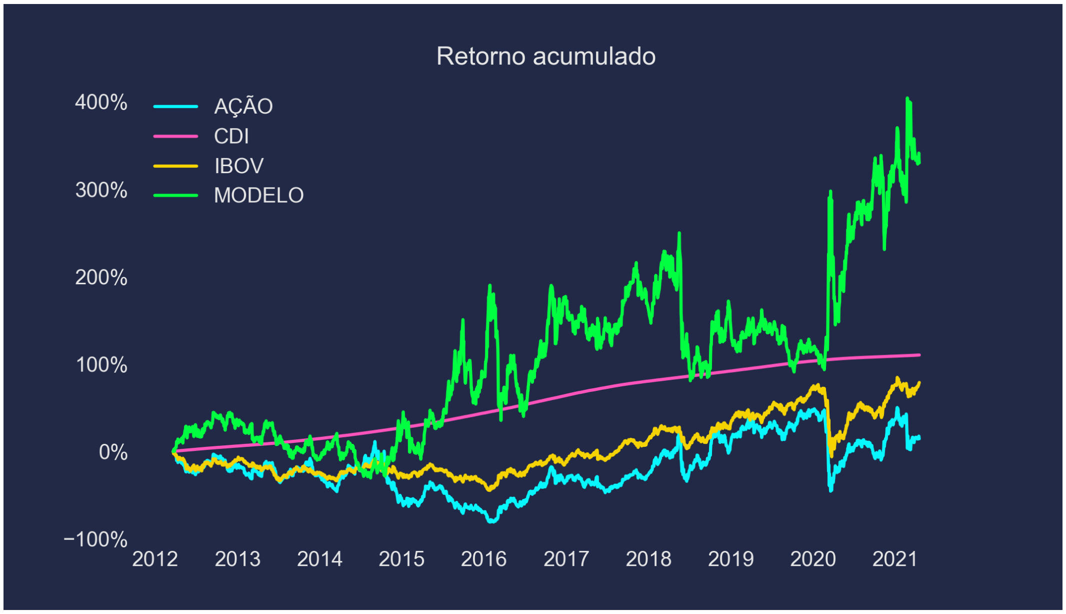
Relatório do Modelo

Dia inicial	2012-03-20
Dia final	2021-04-16
Dias totais	2243

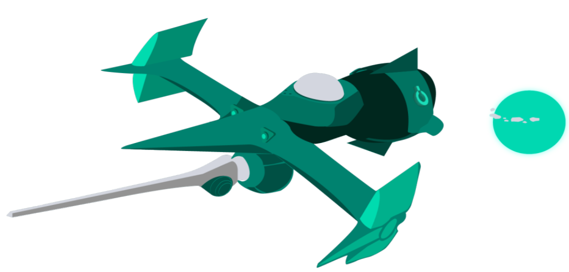


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	330.07%
Retorno acum. ativo	14.5%
Retorno acum. CDI	110.26%
Retorno acum. IBOV	78.82%
Retorno a.a. modelo	17.81%
Vol 252d	48.32%
Índice Sharpe	0.18
VAR diário 95%	-4.74%
Drawdown máximo	-53.31%

Estatísticas de Trade

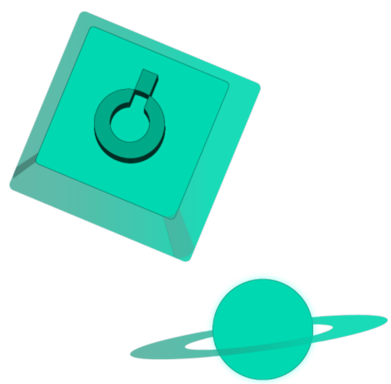
Número de trades	69
% Operações vencedoras	42.03%
% Operações perdedoras	57.97%
Média de ganhos	17.26%
Média de perdas	-6.64%
Expec. matemática por trade	3.4%
Tempo médio de operação	32
Maior sequência de vitória	4
Maior sequência de derrotas	4

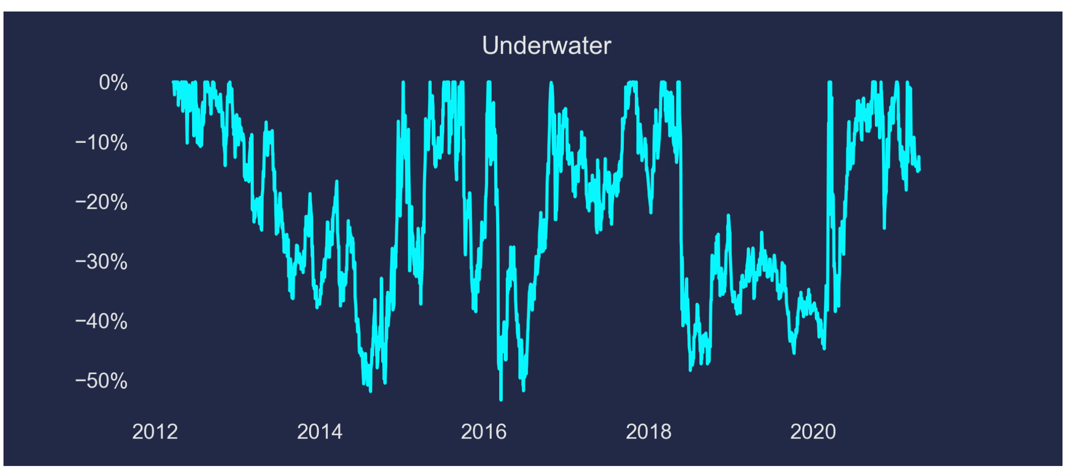


Relatório do Modelo

Eventos de estresse

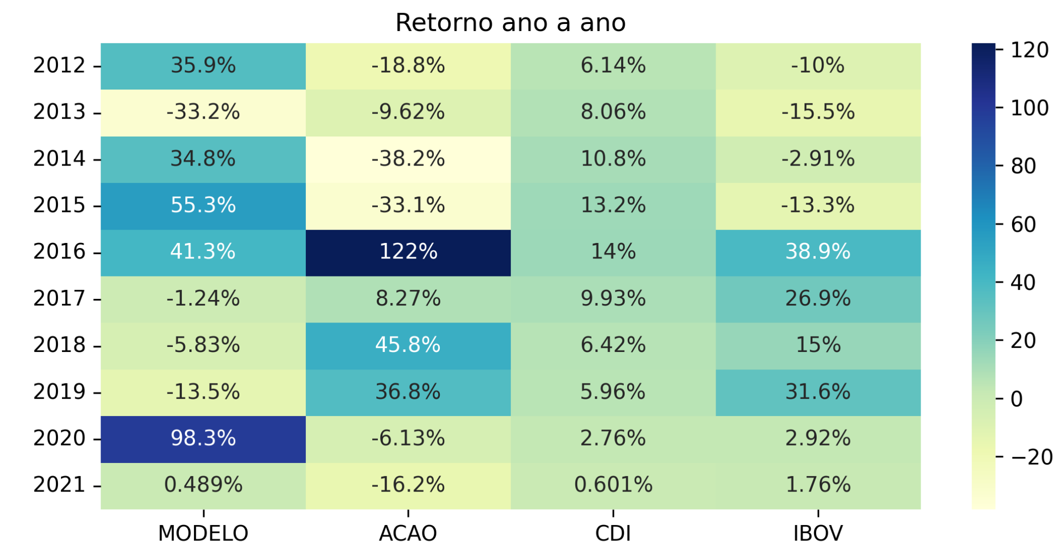
Joesley Day - 18/05/2017	15.76%
Auge pandemia: Março - 2020	39.78%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	-20.09%
Precatórios - ago/nov 2021	-
Crise de 2008	-

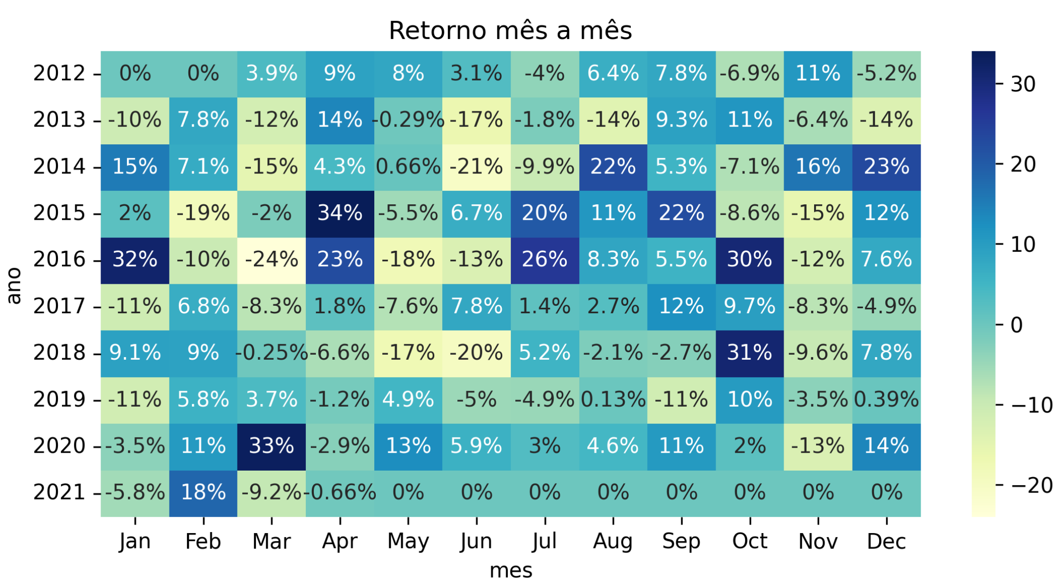




codigo.py

Relatório do Modelo





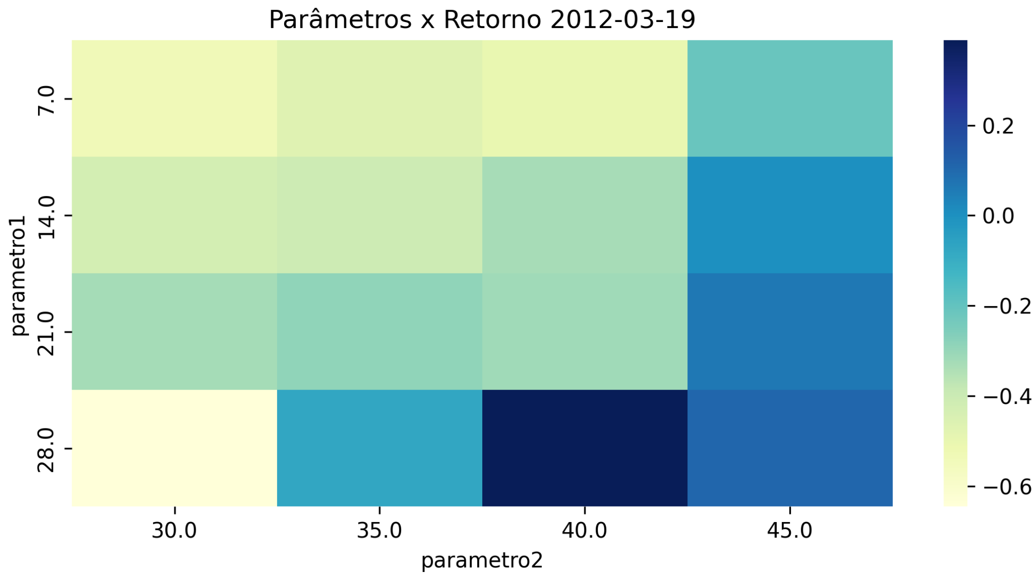
Relatório do Modelo

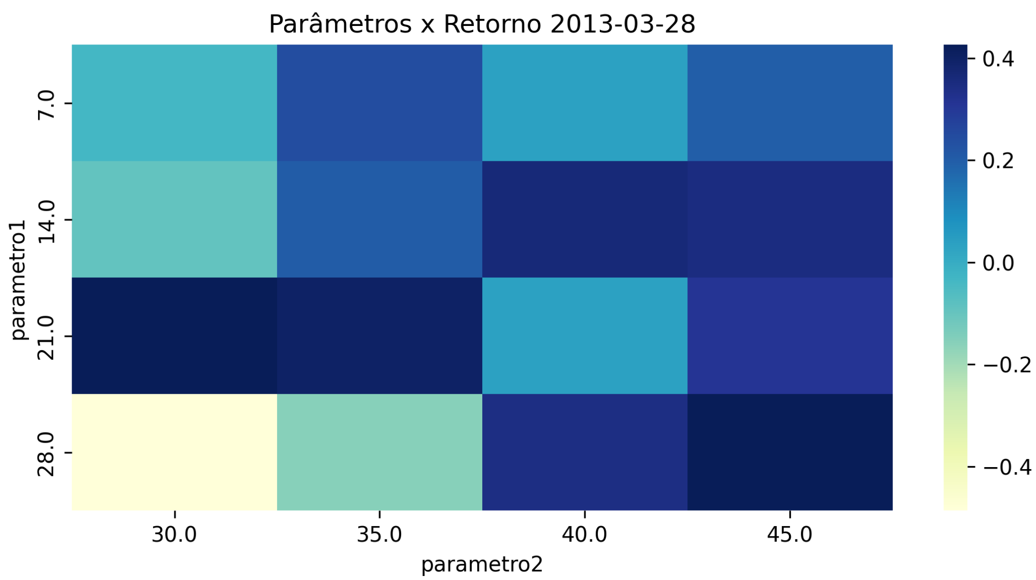
Tabela resultados otimização

Data inicial IS	Data final IS	Retorno IS a.m.	Data inicial OOS	Data final OOS	Retorno OOS a.m.	Parâmetro 1	Parâmetro 2
2010-03-10	2012-03-19	1.37%	2012-03-20	2013-03-28	1.23%	28	40
2011-03-16	2013-03-28	1.49%	2013-04-01	2014-04-02	-2.05%	28	45
2012-03-19	2014-04-02	2.36%	2014-04-03	2015-04-09	2.27%	7	35
2013-03-28	2015-04-09	1.75%	2015-04-10	2016-04-19	4.34%	28	35
2014-04-02	2016-04-19	7.03%	2016-04-20	2017-04-24	1.65%	21	30
2015-04-09	2017-04-24	5.72%	2017-04-25	2018-05-02	1.57%	21	30
2016-04-19	2018-05-02	2.63%	2018-05-03	2019-05-13	-1.2%	21	35
2017-04-24	2019-05-13	1.4%	2019-05-14	2020-05-18	1.69%	21	35
2018-05-02	2020-05-18	0.67%	2020-05-19	2021-04-16	3.21%	14	35

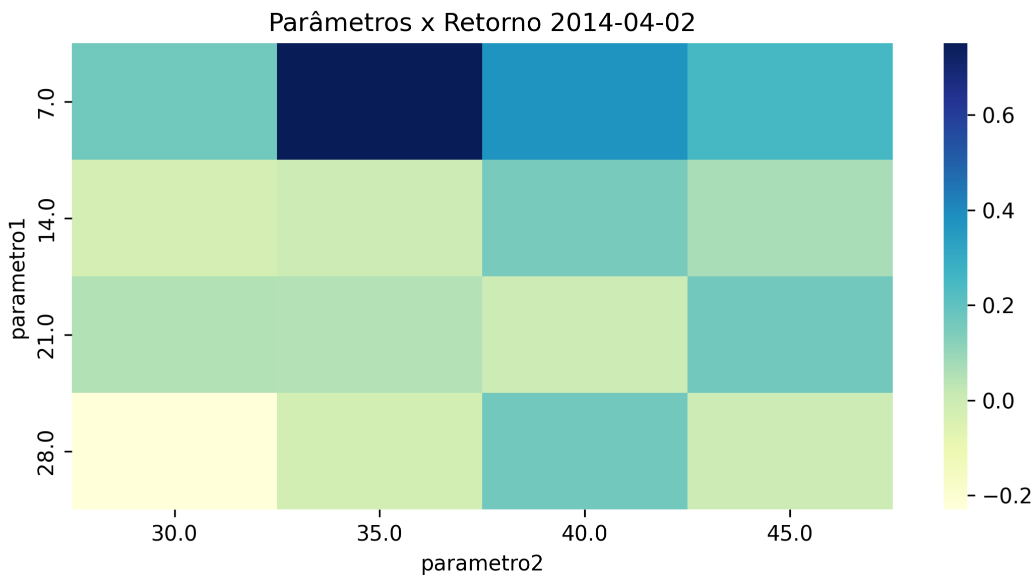
Retono médio IS	Retorno médio OOS
2.71%	**1.41%**

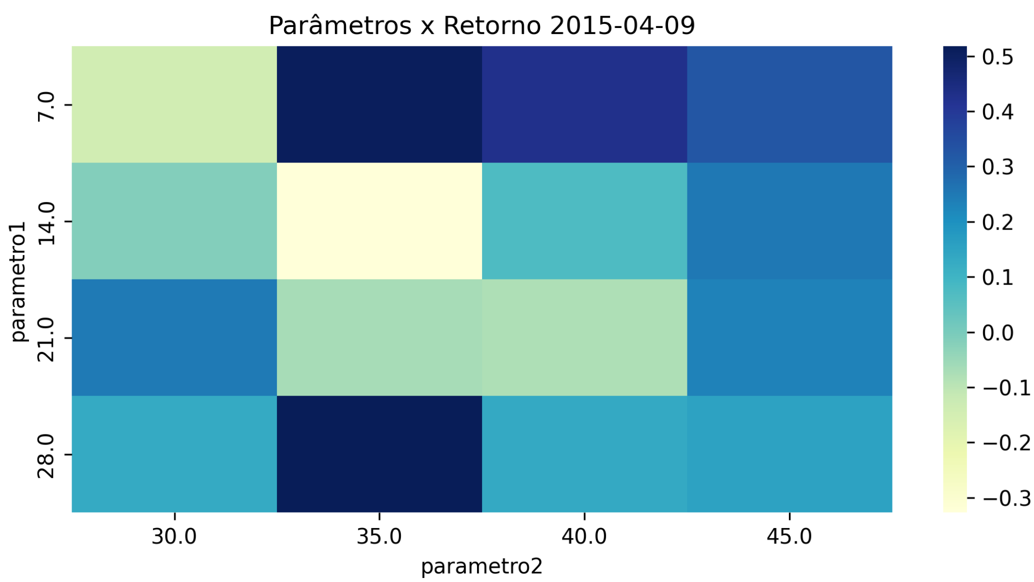
Relatório do Modelo



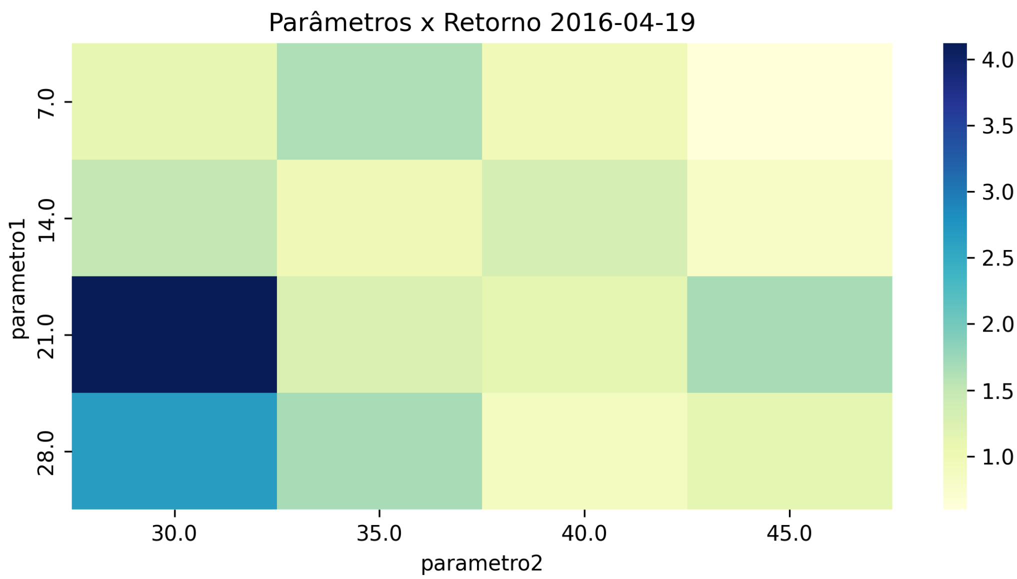


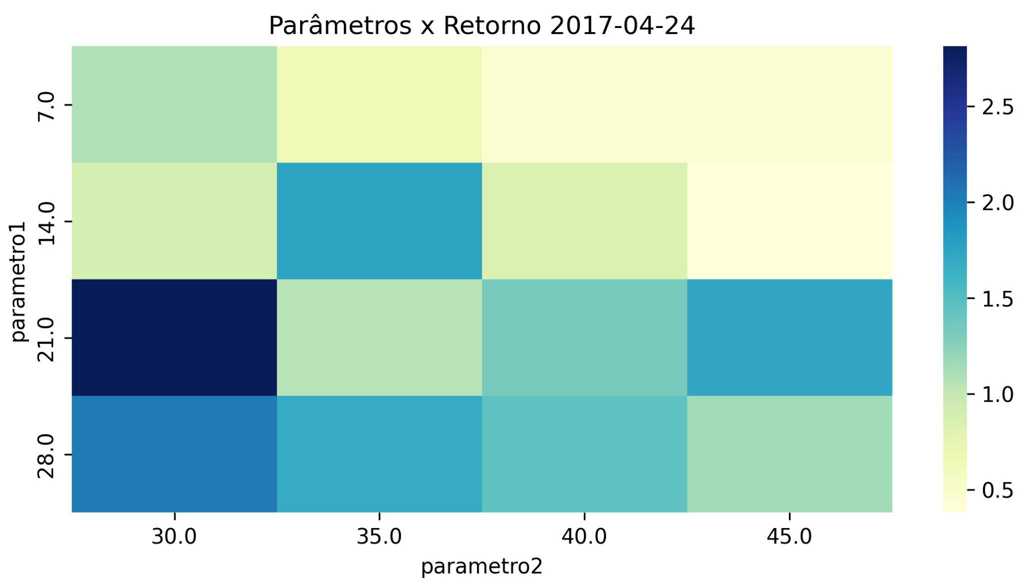
Relatório do Modelo



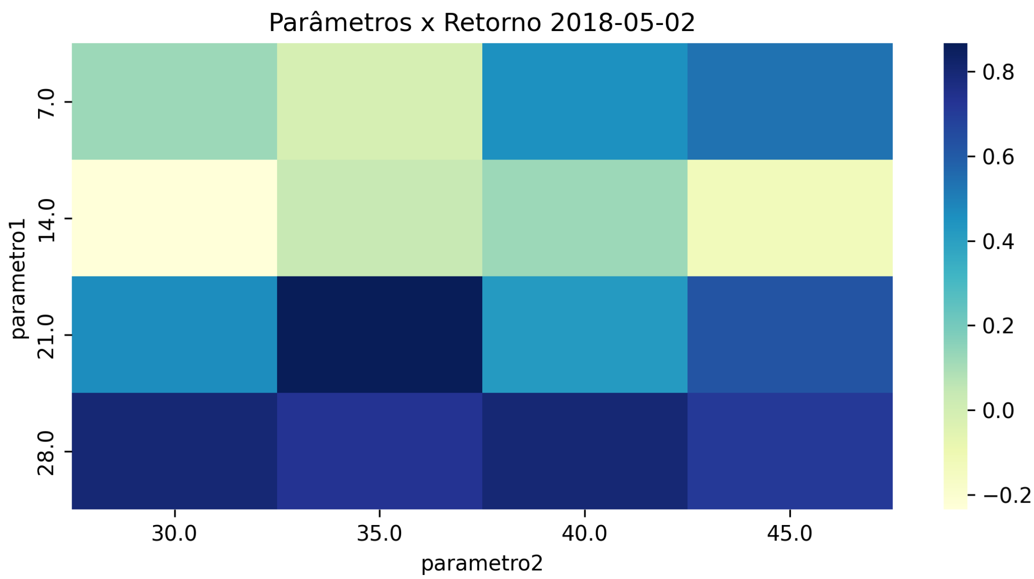


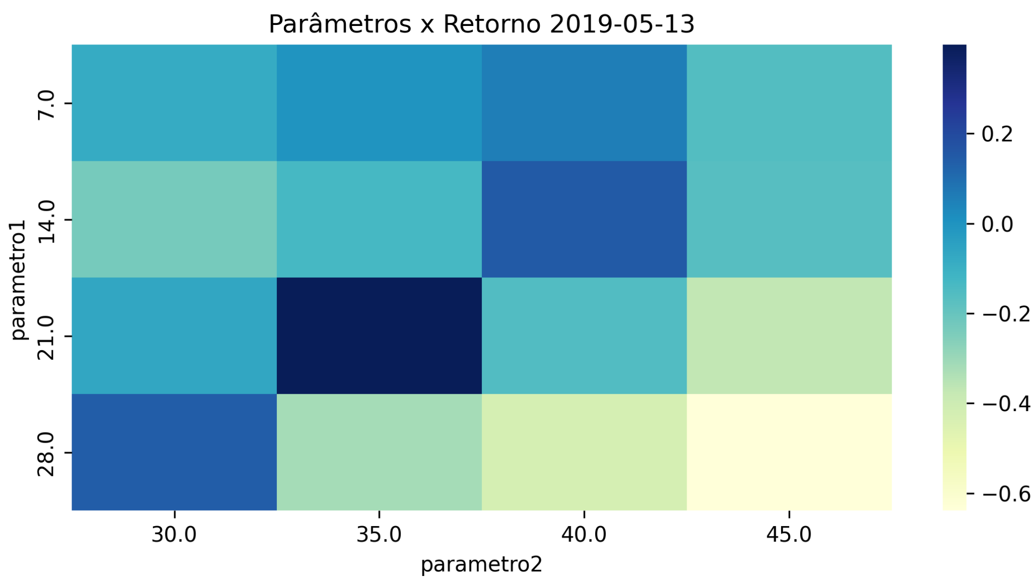
Relatório do Modelo





Relatório do Modelo





Relatório do Modelo