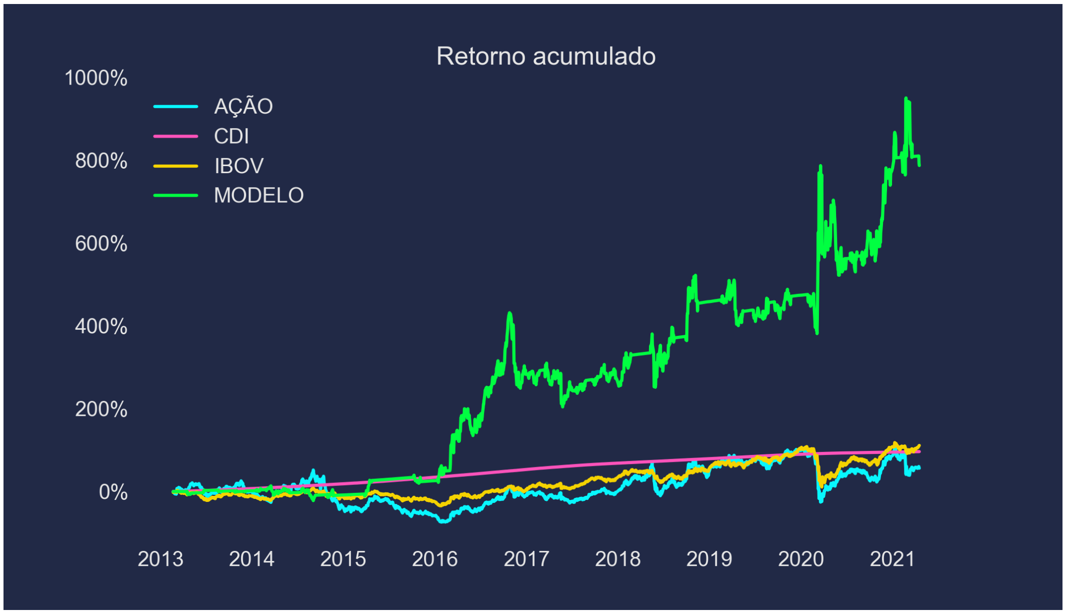
código.py

# Relatório do Modelo

| | |
|---|---|
| Dia inicial | 2013-02-20 |
| Dia final | 2021-04-16 |
| Dias totais | 2018 |

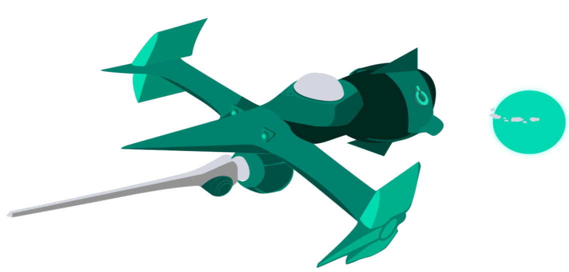



### Estatísticas de Retorno e Risco

| | |
|---|---|
| Retorno acum. modelo | 787.31% |
| Retorno acum. ativo | 56.35% |
| Retorno acum. CDI | 96.36% |
| Retorno acum. IBOV | 111.32% |
| Retorno a.a. modelo | 31.34% |
| Vol 252d | 45.15% |
| Índice Sharpe | 0.54 |
| VAR diário 95% | -3.7% |
| Drawdown máximo | -42.77% |

### Estatísticas de Trade

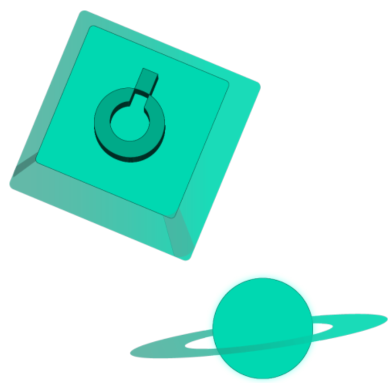
| | |
|---|---|
| Número de trades | 52 |
| % Operações vencedoras | 51.92% |
| % Operações perdedoras | 48.08% |
| Média de ganhos | 16.74% |
| Média de perdas | -6.34% |
| Expec. matemática por trade | 5.64% |
| Tempo médio de operação | 21 |
| Maior sequência de vitória | 3 |
| Maior sequência de derrotas | 3 |

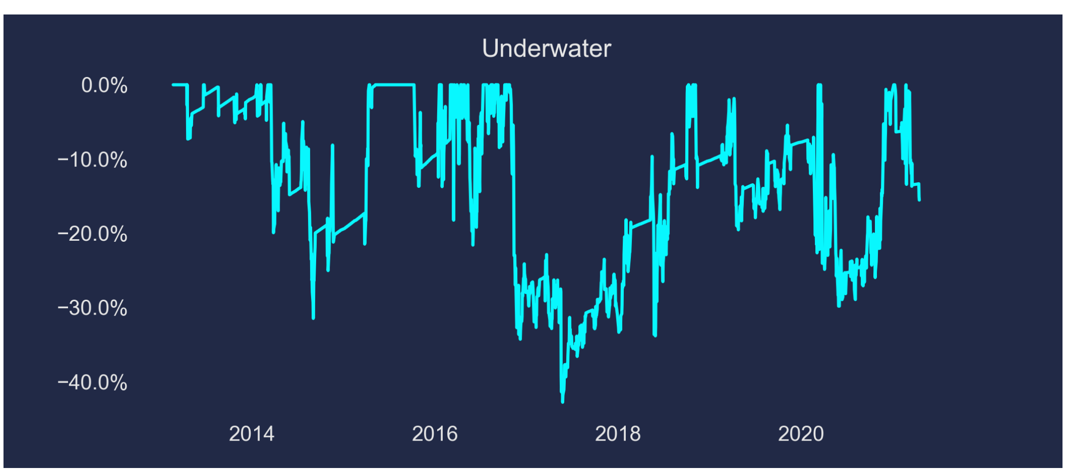


# Relatório do Modelo


### Eventos de estresse

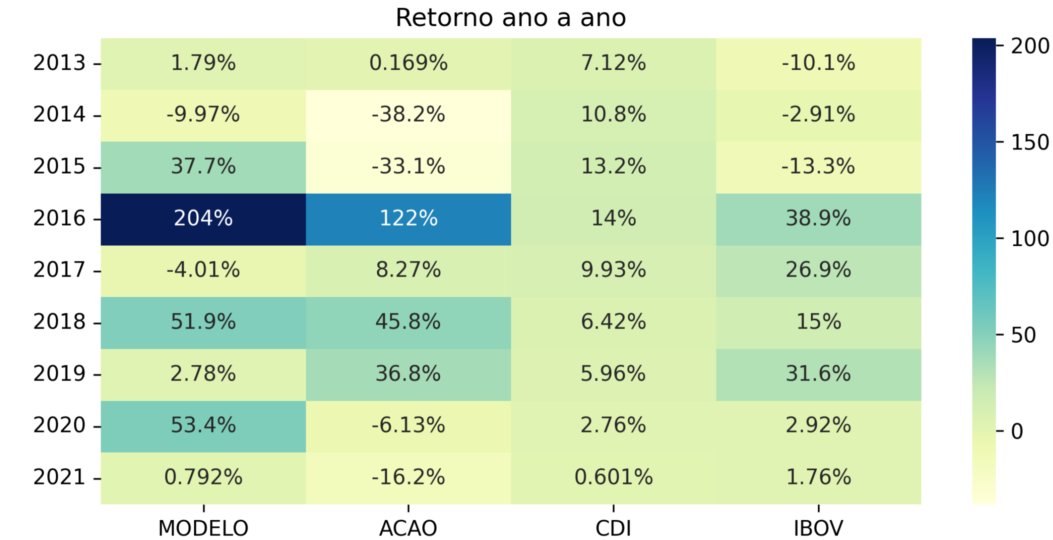
| | |
|---|---|
| Joesley Day - 18/05/2017 | -15.76% |
| Auge pandemia: Março - 2020 | 38.03% |
| Boa sorte Day - 10/11/2022 | - |
| Greve dos caminhoneiros - 2018 | -17.19% |
| Precatórios - ago/nov 2021 | - |
| Crise de 2008 | - |

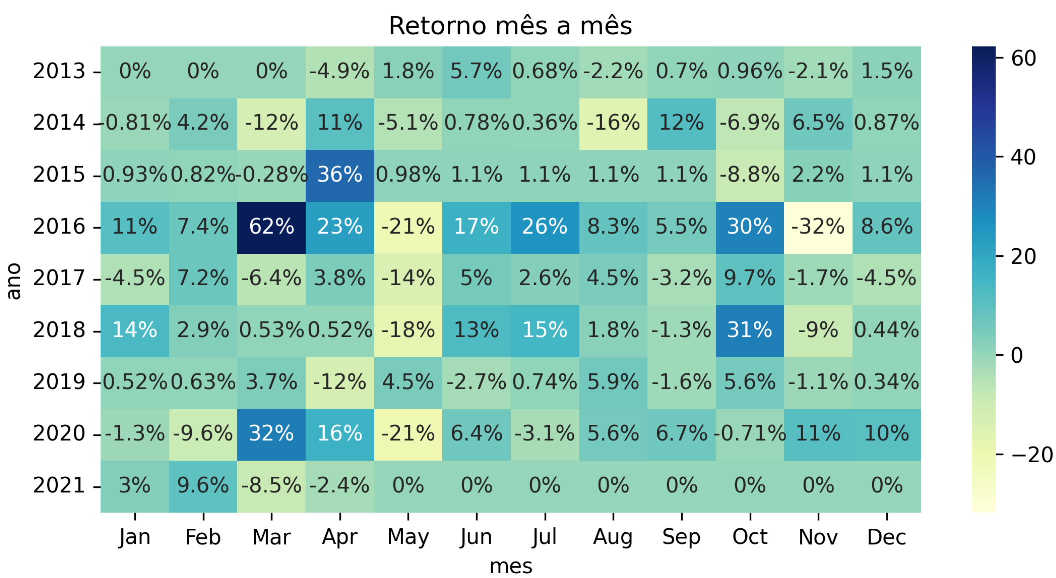




código.py

# Relatório do Modelo



código.py

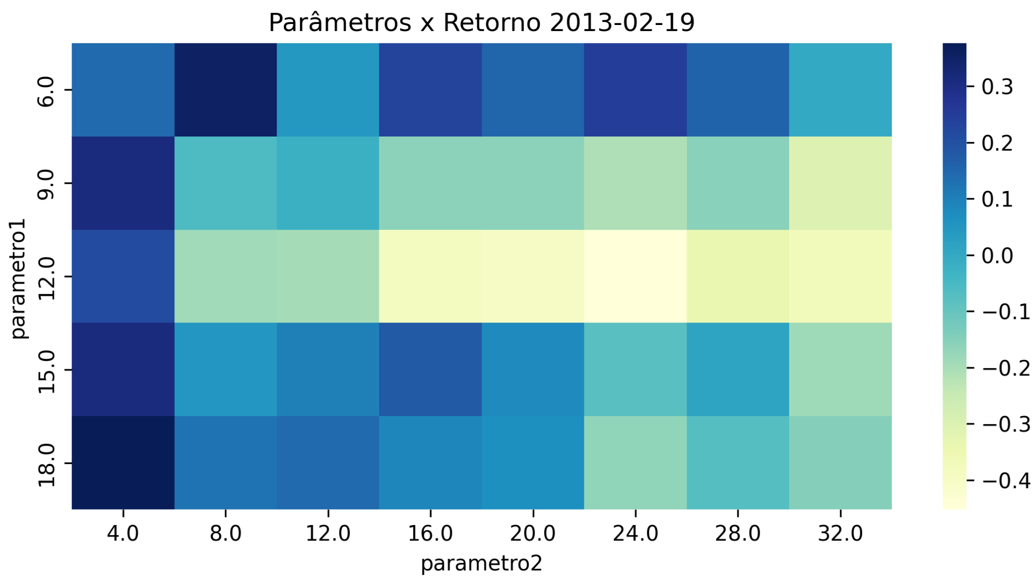
# Relatório do Modelo

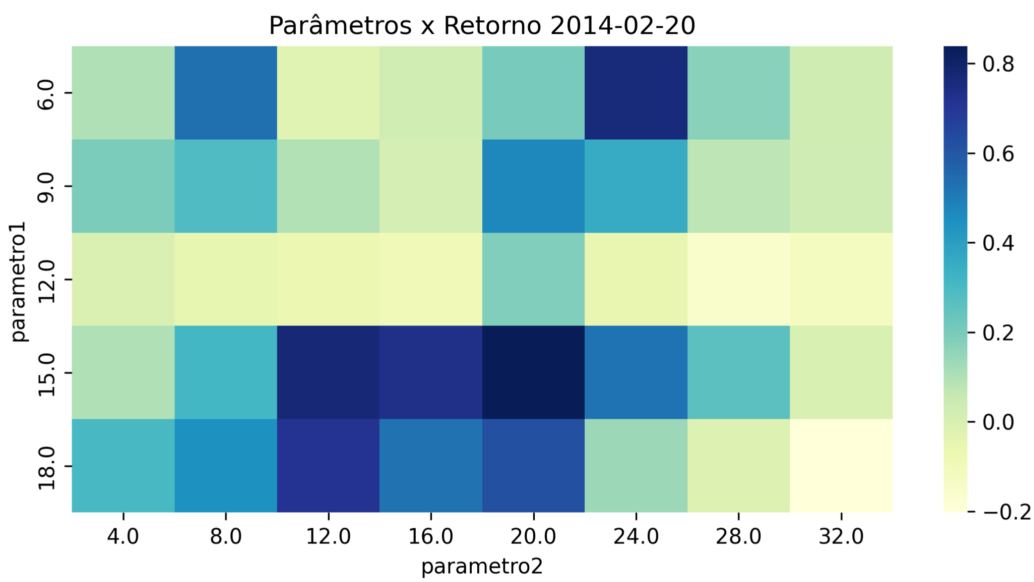
### Tabela resultados otimização

| Data inicial IS | Data final IS | Retorno IS a.m. | Data inicial OOS | Data final OOS | Retorno OOS a.m. | Parâmetro 1 | Parâmetro 2 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2010-01-28 | 2013-02-19 | 0.89% | 2013-02-20 | 2014-02-20 | 0.37% | 18 | 4 |
| 2011-02-03 | 2014-02-20 | 1.7% | 2014-02-21 | 2015-03-02 | -0.94% | 15 | 20 |
| 2012-02-07 | 2015-03-02 | 0.9% | 2015-03-03 | 2016-03-10 | 7.91% | 18 | 20 |
| 2013-02-19 | 2016-03-10 | 4.19% | 2016-03-11 | 2017-03-14 | 4.49% | 15 | 32 |
| 2014-02-20 | 2017-03-14 | 4.34% | 2017-03-15 | 2018-03-22 | 0.76% | 15 | 32 |
| 2015-03-02 | 2018-03-22 | 4.2% | 2018-03-23 | 2019-04-02 | 2.65% | 15 | 32 |
| 2016-03-10 | 2019-04-02 | 3.77% | 2019-04-03 | 2020-04-06 | 1.25% | 9 | 20 |
| 2017-03-14 | 2020-04-06 | 3.49% | 2020-04-07 | 2021-04-14 | 2.39% | 9 | 20 |
| 2018-03-22 | 2021-04-14 | 3.52% | 2021-04-15 | 2021-04-16 | -23.65% | 9 | 20 |

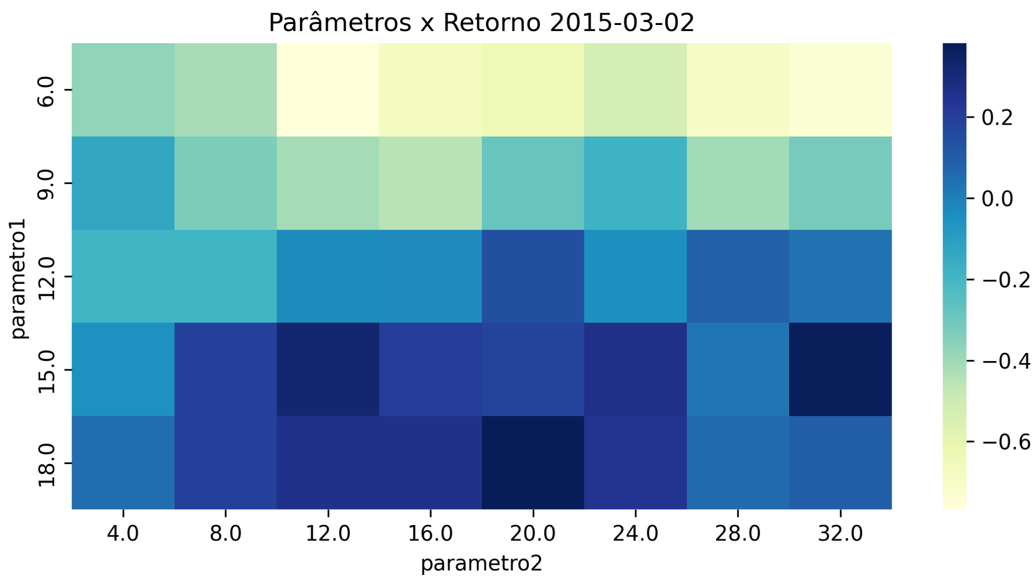
| Retono médio IS | Retorno médio OOS |
|---|---|
| **3.0%** | **-0.53%** |

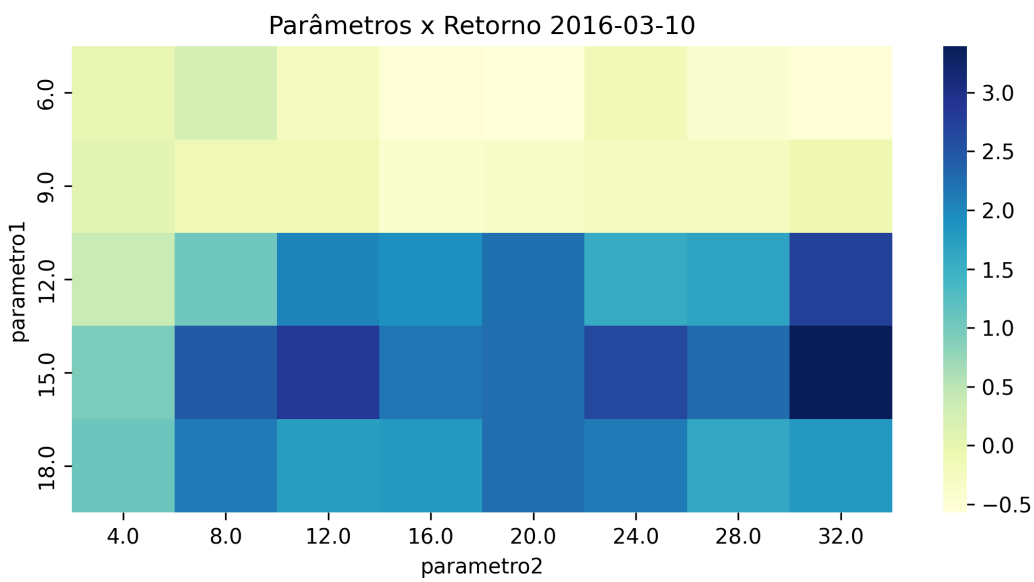
# Relatório do Modelo



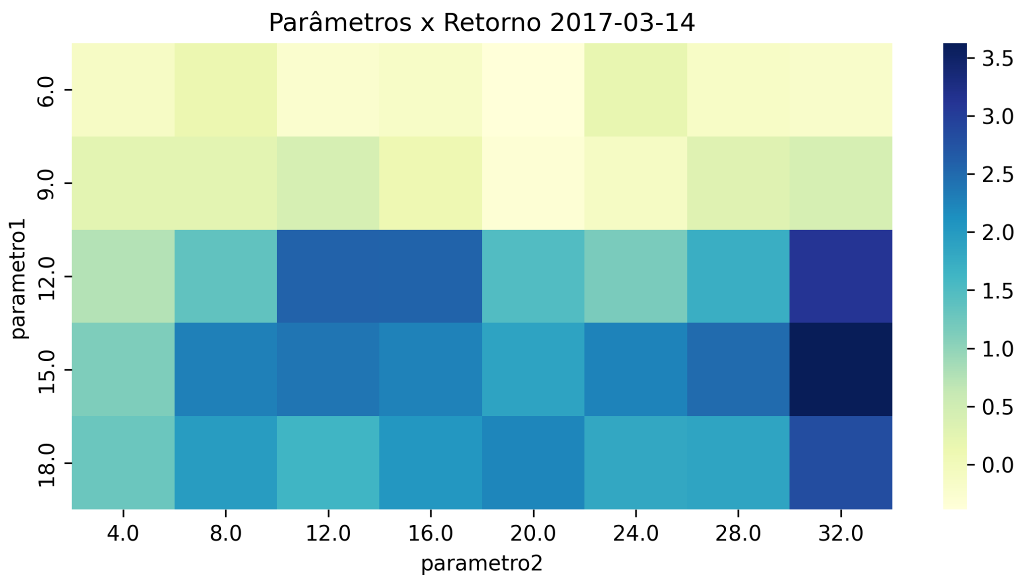



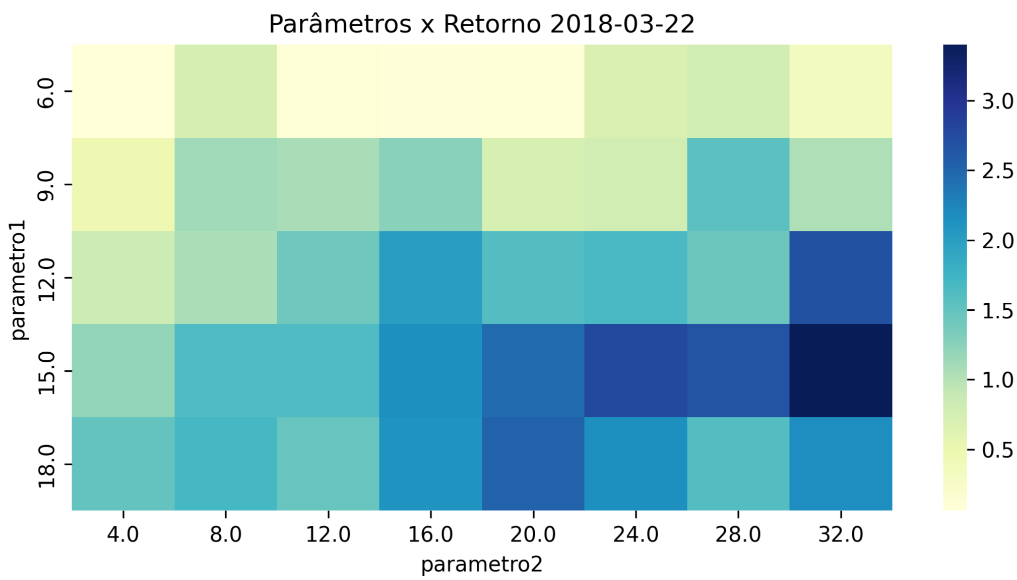
# Relatório do Modelo



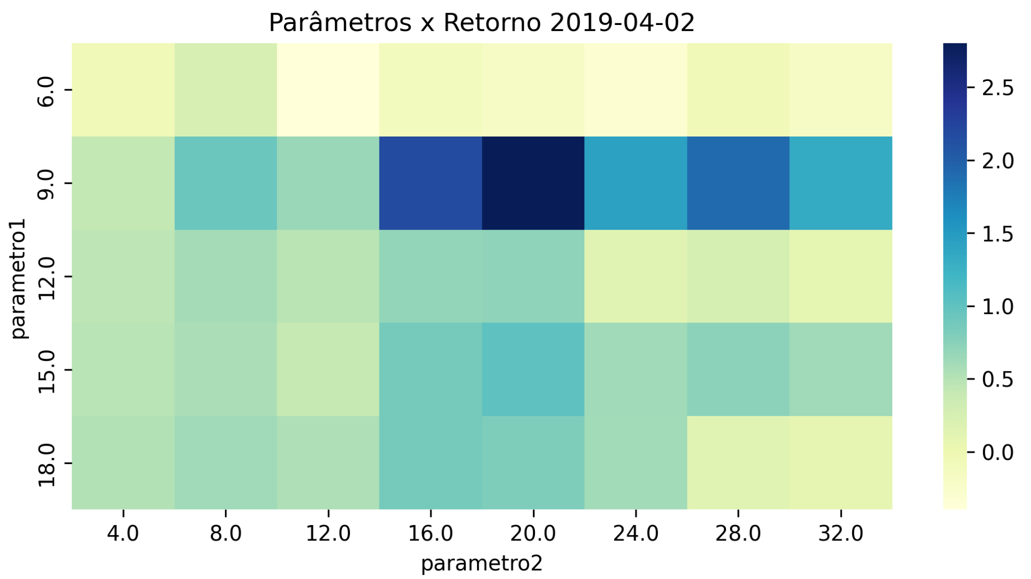



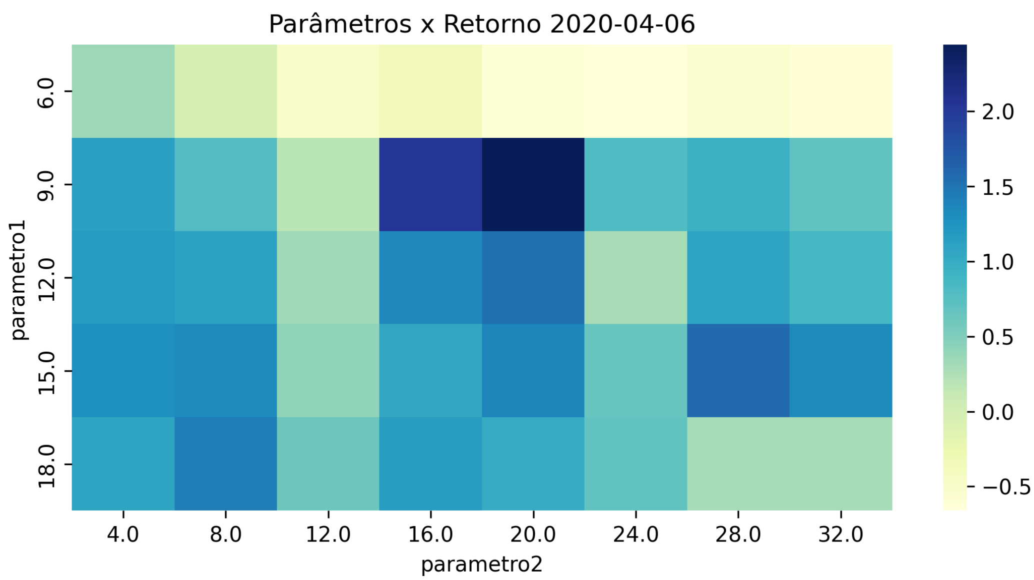
# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo



código.py

# Relatório do Modelo