

# Relatório do Modelo

Dia inicial	2017-12-28
Dia final	2023-12-27
Dias totais	1486
Liquidez	> 1000000
Betas	0 < B > 1.6
Vol. Mensal	0% < V > 23.0%
Indicadores	MMT_1M, Ebit/DivLiq, EV/Ebit, P/VPA, P/SR



## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	654.85%
Retorno acum. CDI	53.67%
Retorno acum. IBOV	76.4%
Retorno a.a. modelo	40.89%
Vol 252d	29.42%
Índice Sharpe	1.19
VAR diário 95%	-2.52%
Turn over carteira	59.07%
Drawdown máximo	-49.38%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	71
% Operações vencedoras	69.01%
% Operações perdedoras	30.99%
Média de ganhos	7.49%
Média de perdas	-5.83%
Expec. matemática por trade	3.36%
Maior sequência de vitória	10
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	63.89%

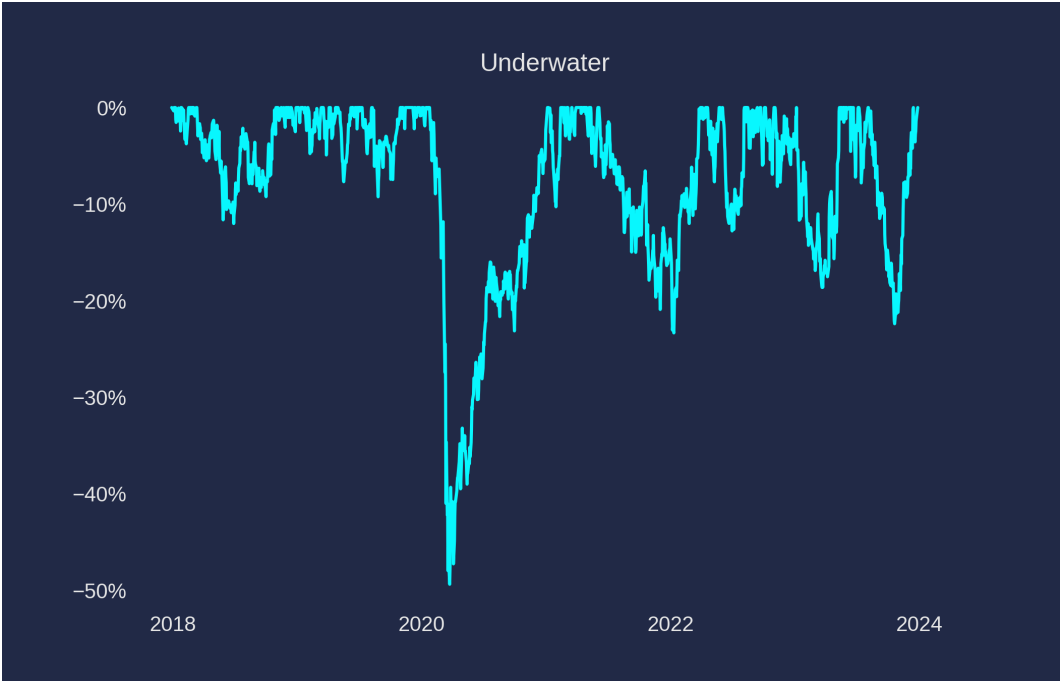
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

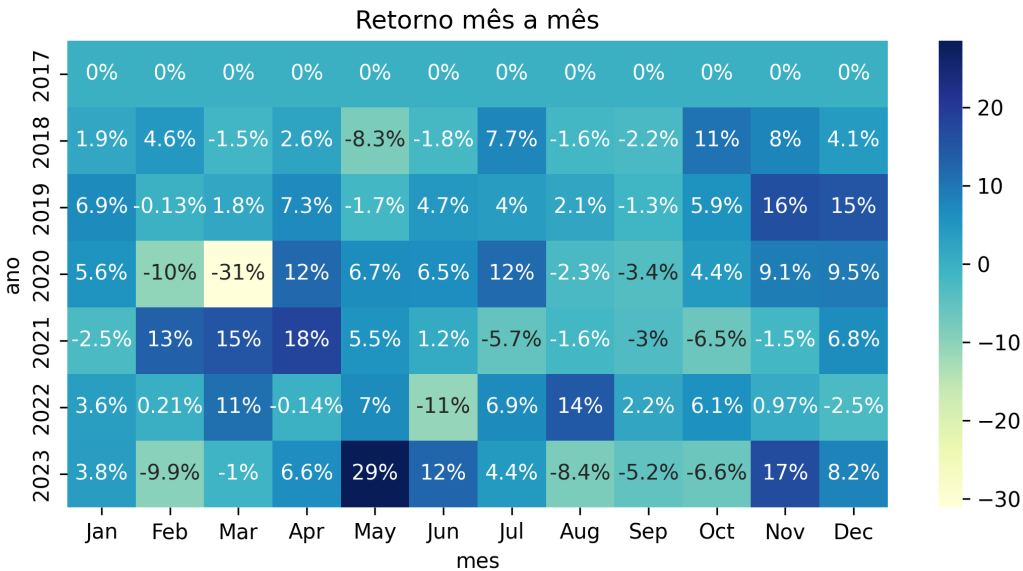
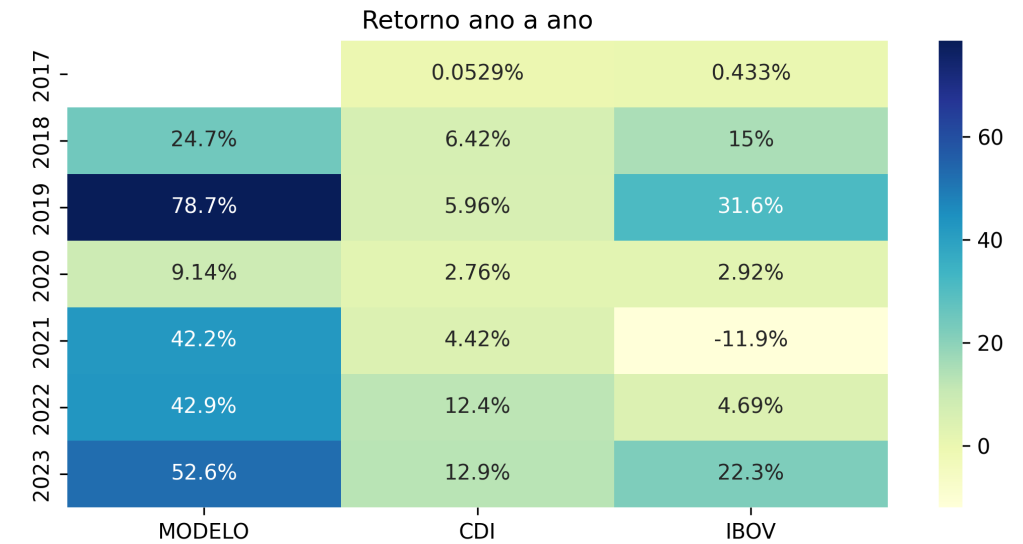
Joesley Day - 18/05/2017	-
Auge pandemia: Março - 2020	-33.7%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-5.28%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-4.64%
Precatórios - ago/nov 2021	-11.29%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-45.88%
Pior período de 3 meses	-43.68%
Pior período de 6 meses	-21.72%
Pior período de 1 ano	-8.93%
Pior período de 2 anos	18.02%
Pior período de 3 anos	91.26%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

