

# Relatório do Modelo

Dia inicial	2023-01-02
Dia final	2023-12-27
Dias totais	246
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	68.85%
Retorno acum. CDI	12.94%
Retorno acum. IBOV	22.29%
Retorno a.a. modelo	71.02%
Vol 252d	27.89%
Índice Sharpe	2.07
VAR diário 95%	-2.43%
Turn over carteira	55.0%
Drawdown máximo	-21.12%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	12
% Operações vencedoras	66.67%
% Operações perdedoras	33.33%
Média de ganhos	11.54%
Média de perdas	-7.92%
Expec. matemática por trade	5.05%
Maior sequência de vitória	4
Maior sequência de derrotas	2
% Meses carteira > IBOV	61.54%

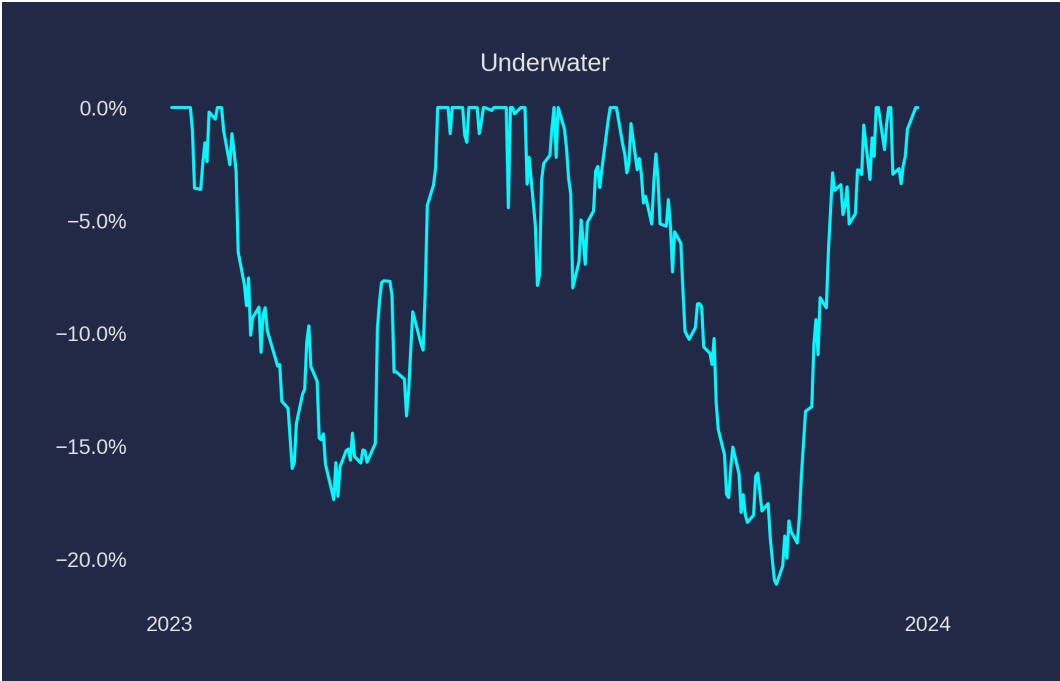
# Relatório do Modelo

Eventos de estresse

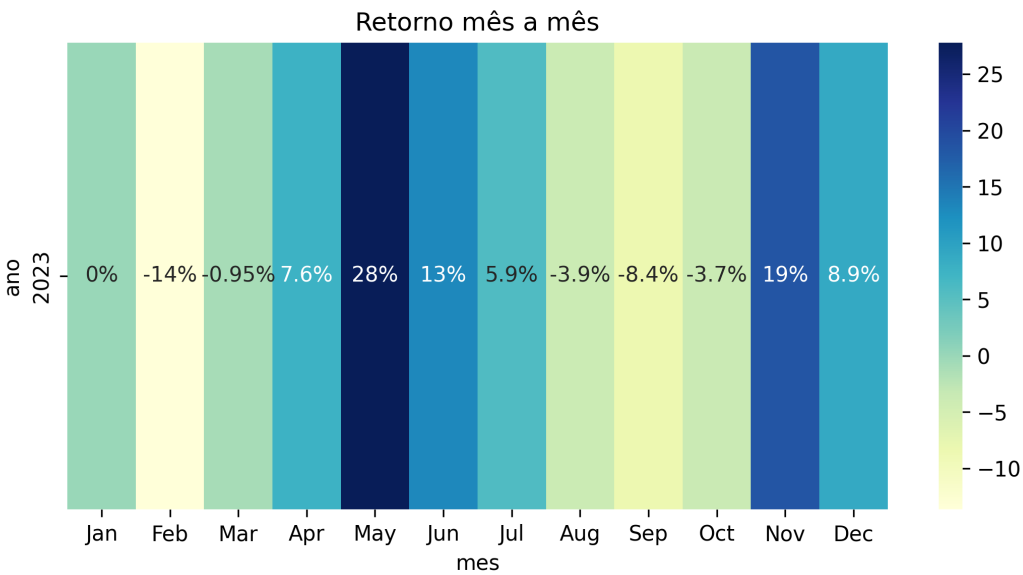
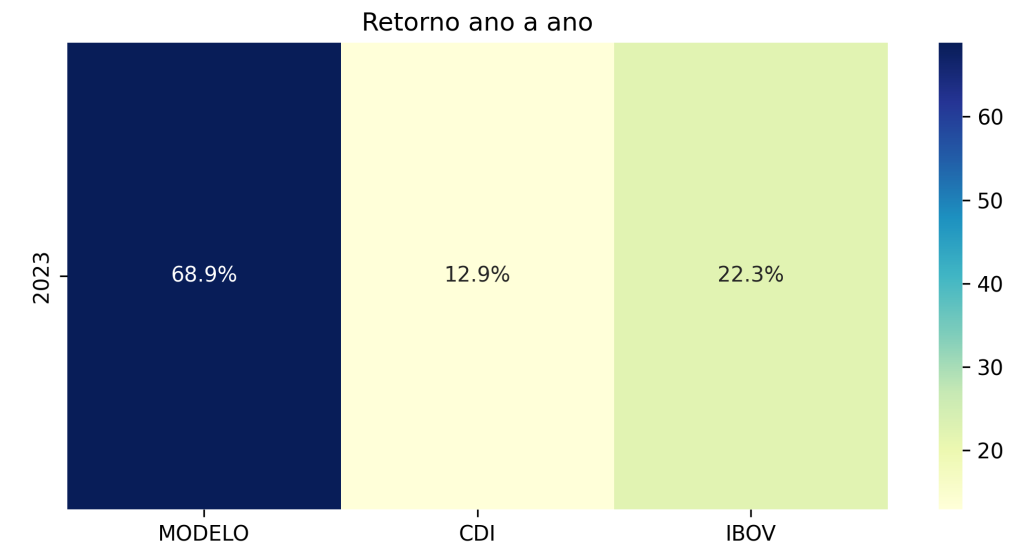
Joesley Day - 18/05/2017	-
Auge pandemia: Março - 2020	-
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	-
Precatórios - ago/nov 2021	-
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-15.12%
Pior período de 3 meses	-16.35%
Pior período de 6 meses	9.2%
Pior período de 1 ano	nan%
Pior período de 2 anos	nan%
Pior período de 3 anos	nan%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

