

# Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-10-24
Dia final	2025-08-28
Dias totais	3431



## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	36094.64%
Retorno acum. CDI	249.08%
Retorno acum. IBOV	155.27%
Retorno a.a. modelo	54.14%
Vol 252d	28.81%
Índice Sharpe	1.11
VAR diário 95%	-3.34%
Turn over carteira	52.64%
Drawdown máximo	-57.61%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	164
% Operações vencedoras	59.76%
% Operações perdedoras	40.24%
Média de ganhos	11.55%
Média de perdas	-6.09%
Expec. matemática por trade	4.45%
Maior sequência de vitória	5
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	58.79%

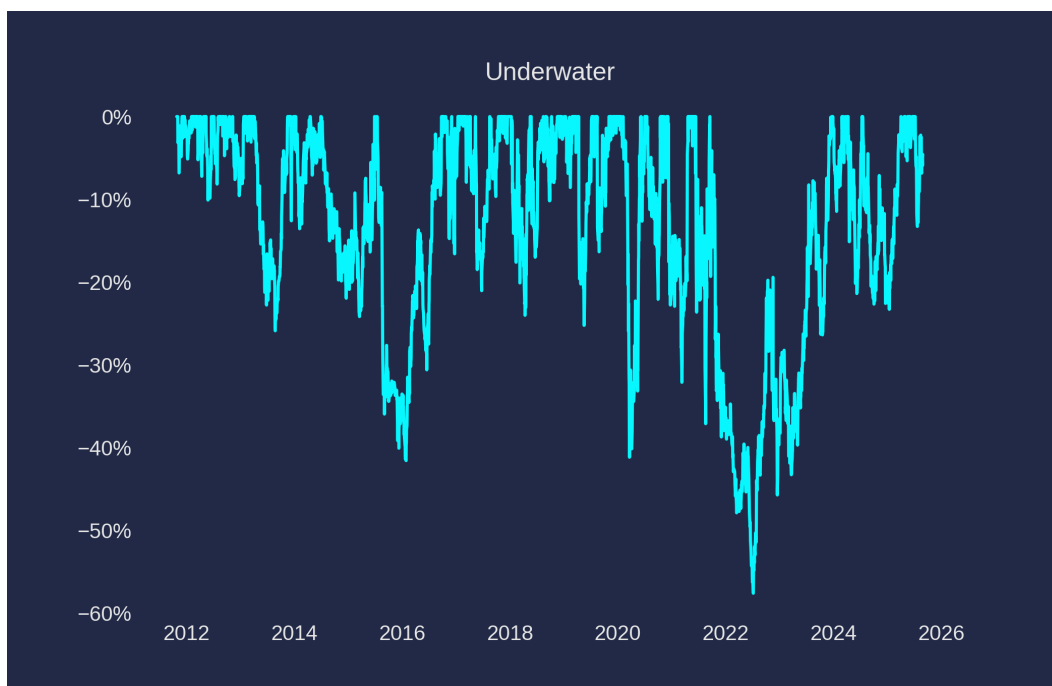
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

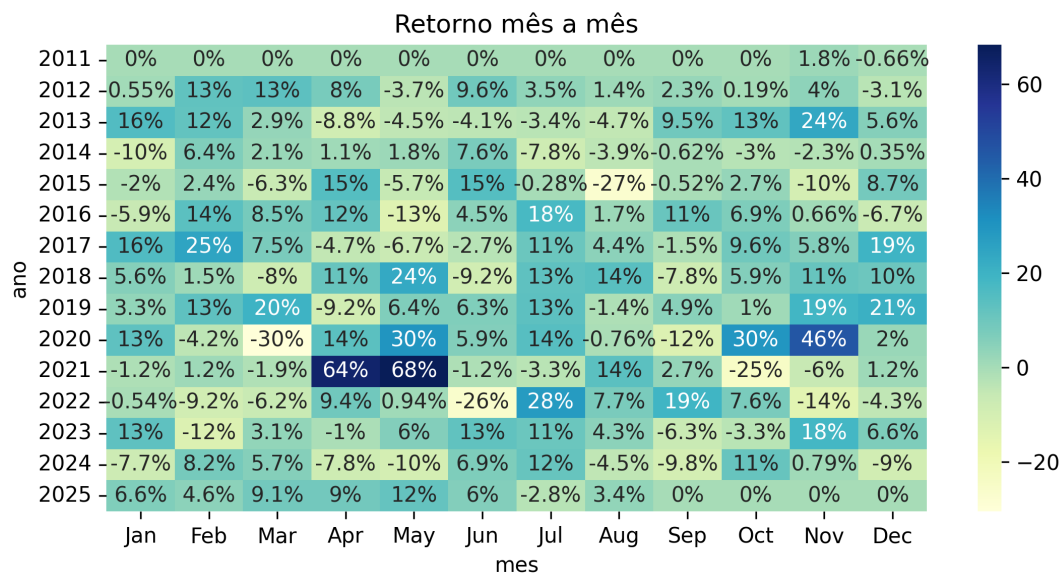
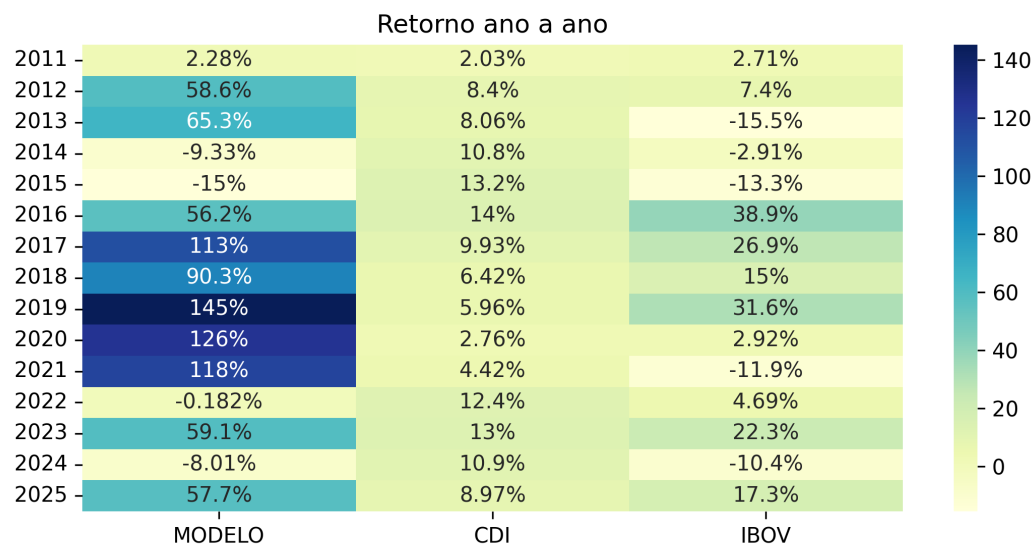
Joesley Day - 18/05/2017	-8.83%
Auge pandemia: Março - 2020	-31.38%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-6.5%
Greve dos caminhoneiros - 2018	39.28%
Precatórios - ago/nov 2021	-15.54%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-39.44%
Pior período de 3 meses	-36.37%
Pior período de 6 meses	-46.44%
Pior período de 1 ano	-47.62%
Pior período de 2 anos	-32.53%
Pior período de 3 anos	-7.63%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

