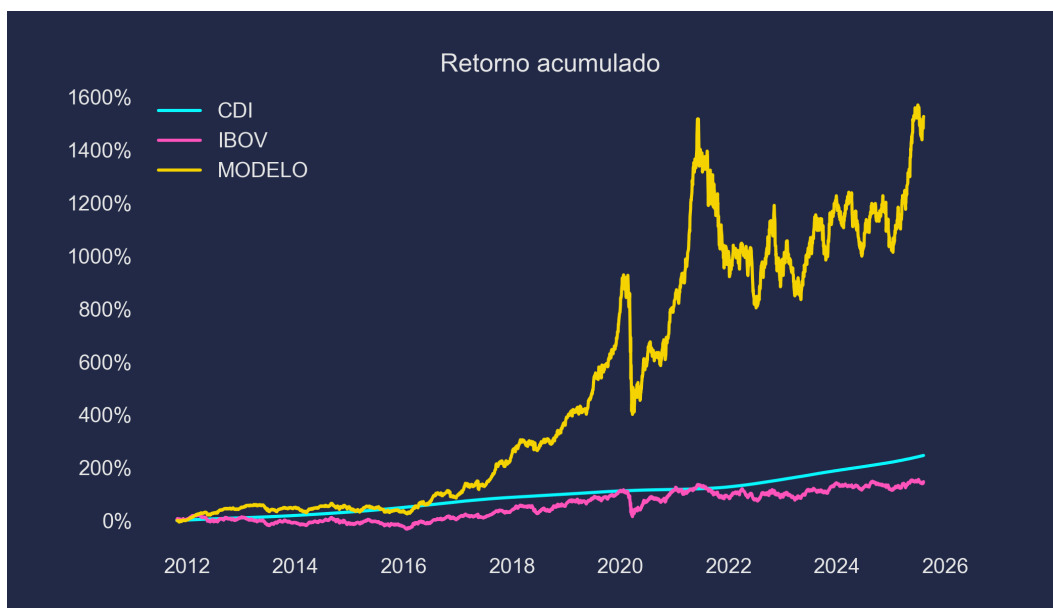


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-10-24
Dia final	2025-08-08
Dias totais	3417



Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	1526.35%
Retorno acum. CDI	246.21%
Retorno acum. IBOV	147.09%
Retorno a.a. modelo	22.84%
Vol 252d	21.6%
Índice Sharpe	0.58
VAR diário 95%	-2.08%
Turn over carteira	34.06%
Drawdown máximo	-51.28%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	163
% Operações vencedoras	64.42%
% Operações perdedoras	35.58%
Média de ganhos	5.96%
Média de perdas	-5.1%
Expec. matemática por trade	2.02%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	7
% Meses carteira > IBOV	59.76%

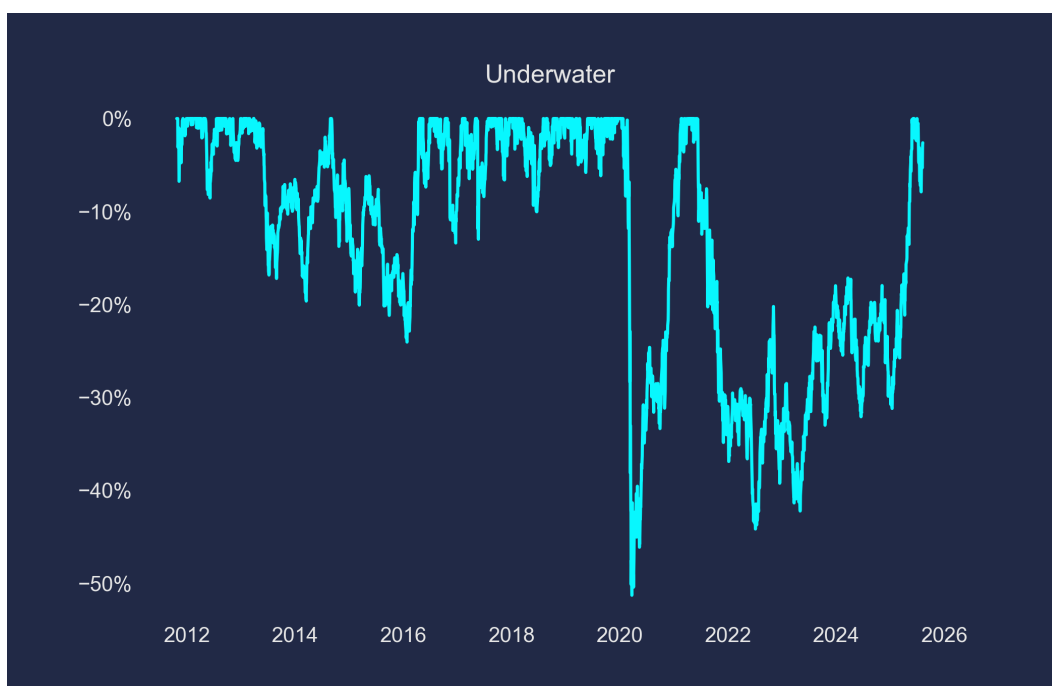
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

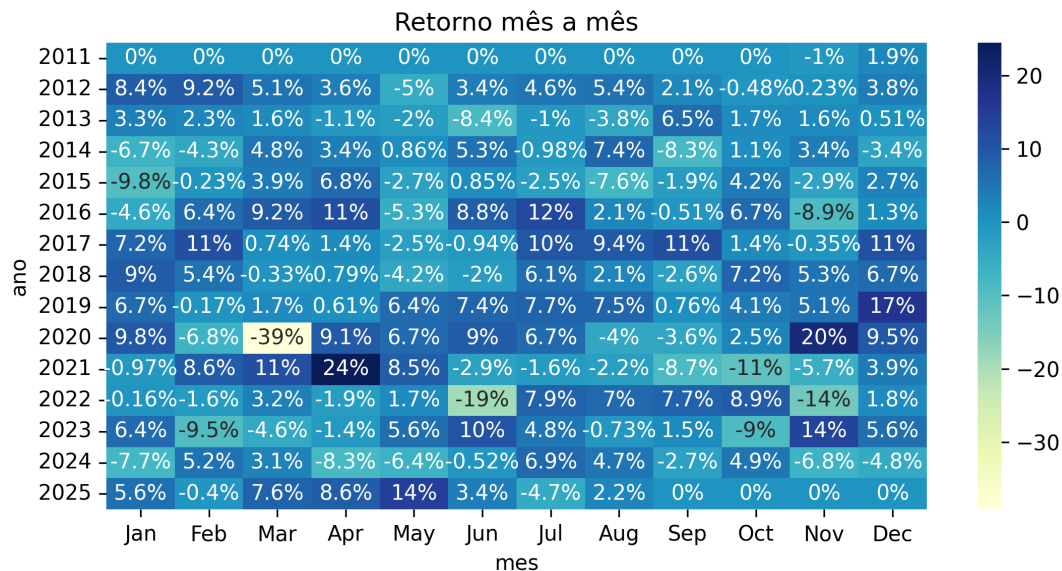
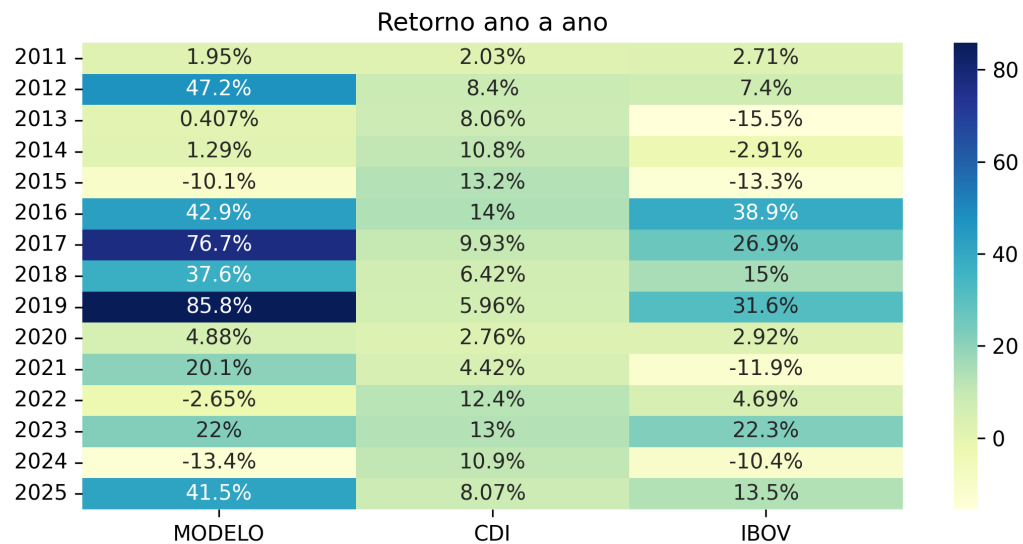
Joesley Day - 18/05/2017	-10.9%
Auge pandemia: Março - 2020	-41.95%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-5.39%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-1.46%
Precatórios - ago/nov 2021	-22.0%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-50.84%
Pior período de 3 meses	-45.83%
Pior período de 6 meses	-31.5%
Pior período de 1 ano	-39.75%
Pior período de 2 anos	-33.94%
Pior período de 3 anos	-32.0%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

