

Relatório do Modelo

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



Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	28844.49%
Retorno acum. CDI	246.21%
Retorno acum. IBOV	147.09%
Retorno a.a. modelo	51.89%
Vol 252d	29.34%
Índice Sharpe	1.06
VAR diário 95%	-3.41%
Turn over carteira	56.24%
Drawdown máximo	-69.08%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	163
% Operações vencedoras	58.9%
% Operações perdedoras	41.1%
Média de ganhos	11.76%
Média de perdas	-6.27%
Expec. matemática por trade	4.35%
Maior sequência de vitória	7
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	56.1%

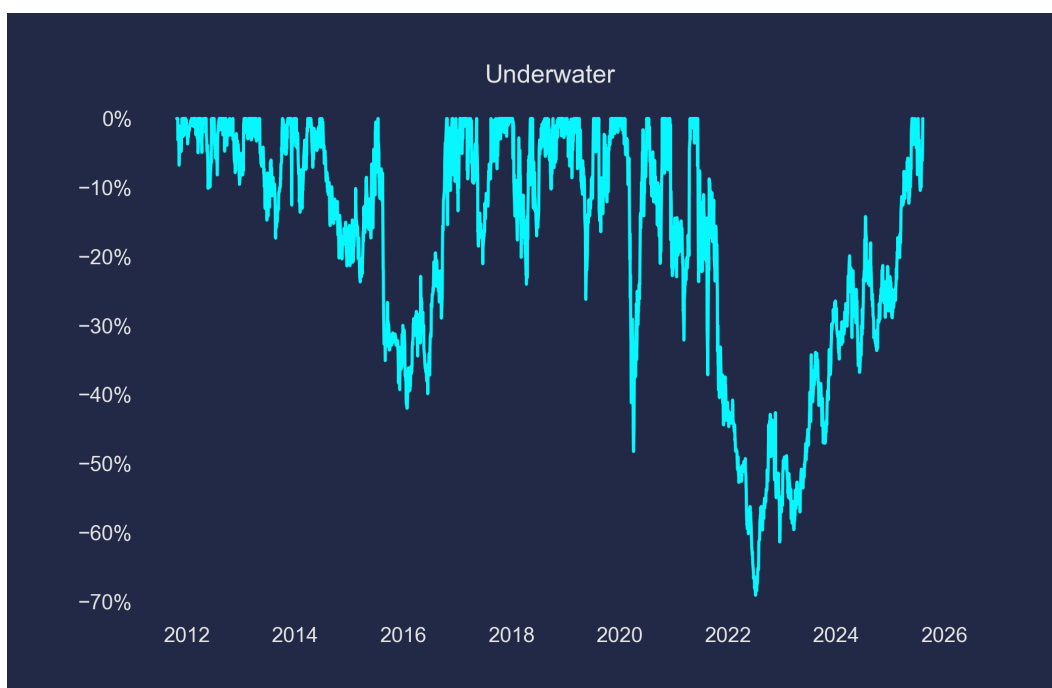
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

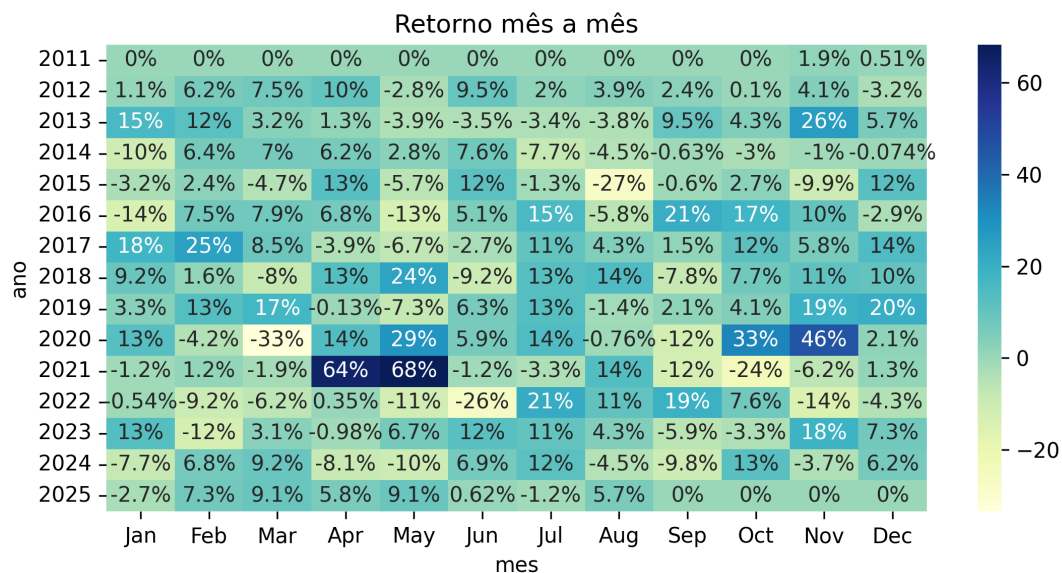
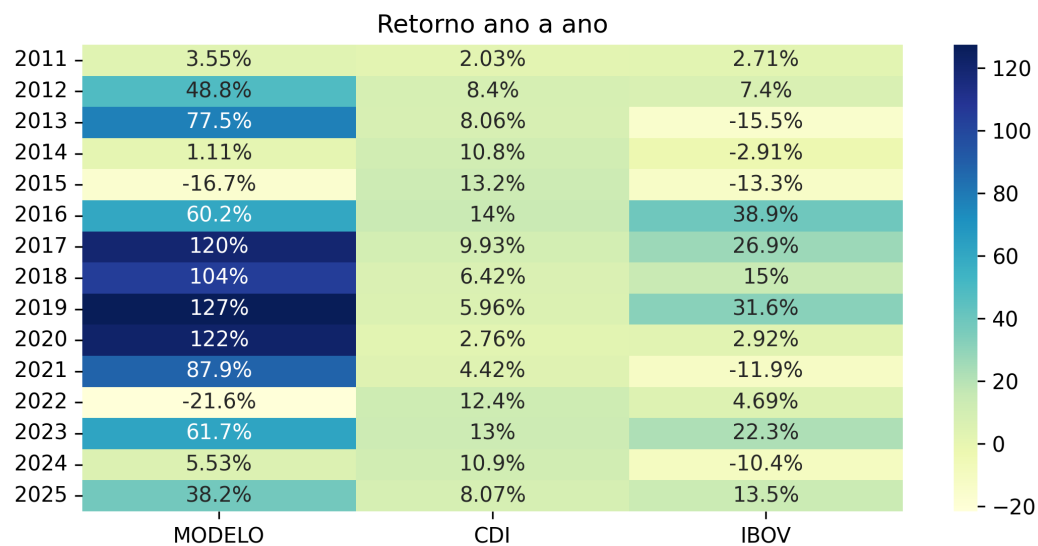
Joesley Day - 18/05/2017	-8.83%
Auge pandemia: Março - 2020	-34.31%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-6.5%
Greve dos caminhoneiros - 2018	42.04%
Precatórios - ago/nov 2021	-26.91%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-44.61%
Pior período de 3 meses	-45.03%
Pior período de 6 meses	-46.34%
Pior período de 1 ano	-63.67%
Pior período de 2 anos	-48.4%
Pior período de 3 anos	-32.99%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

