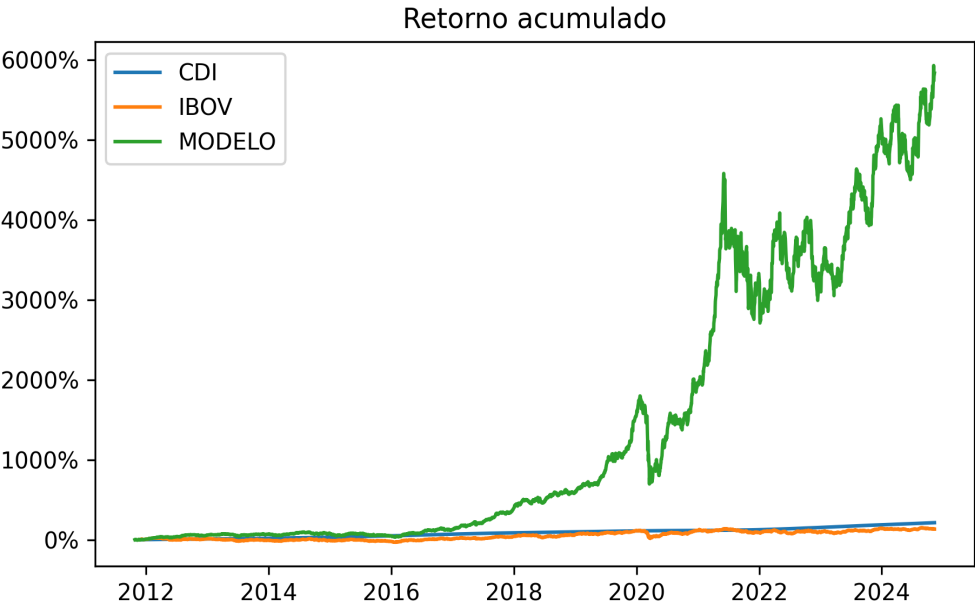


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-24
Dia final	2024-11-11
Dias totais	3236



Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	5836.66%
Retorno acum. CDI	212.97%
Retorno acum. IBOV	132.62%
Retorno a.a. modelo	37.44%
Vol 252d	23.22%
Índice Sharpe	1.01
VAR diário 95%	-2.45%
Turn over carteira	24.97%
Drawdown máximo	-57.98%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	155
% Operações vencedoras	65.16%
% Operações perdedoras	34.84%
Média de ganhos	7.74%
Média de perdas	-5.57%
Expec. matemática por trade	3.1%
Maior sequência de vitória	10
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	63.46%

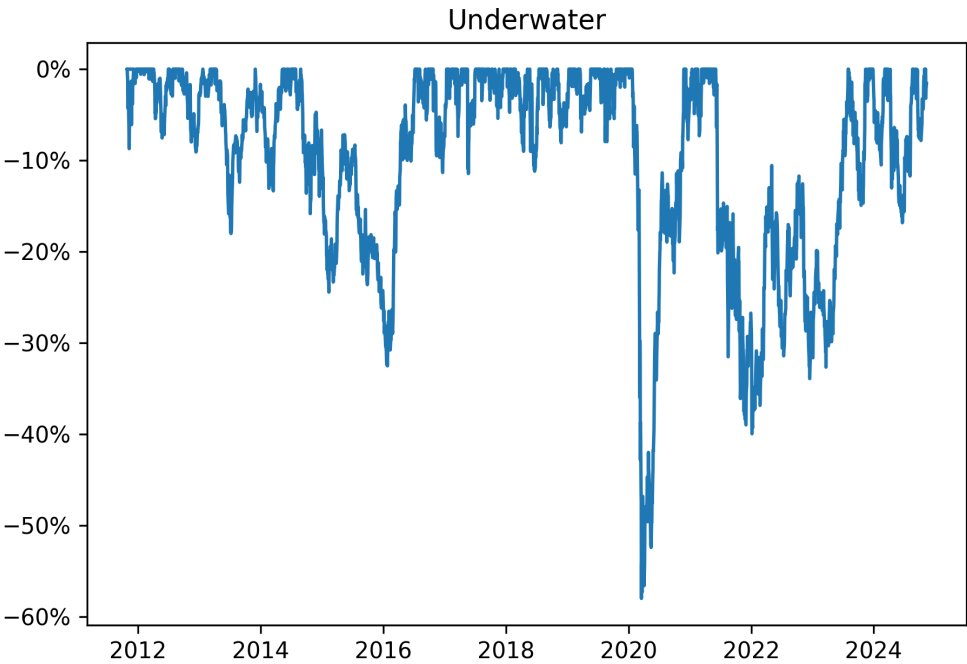
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

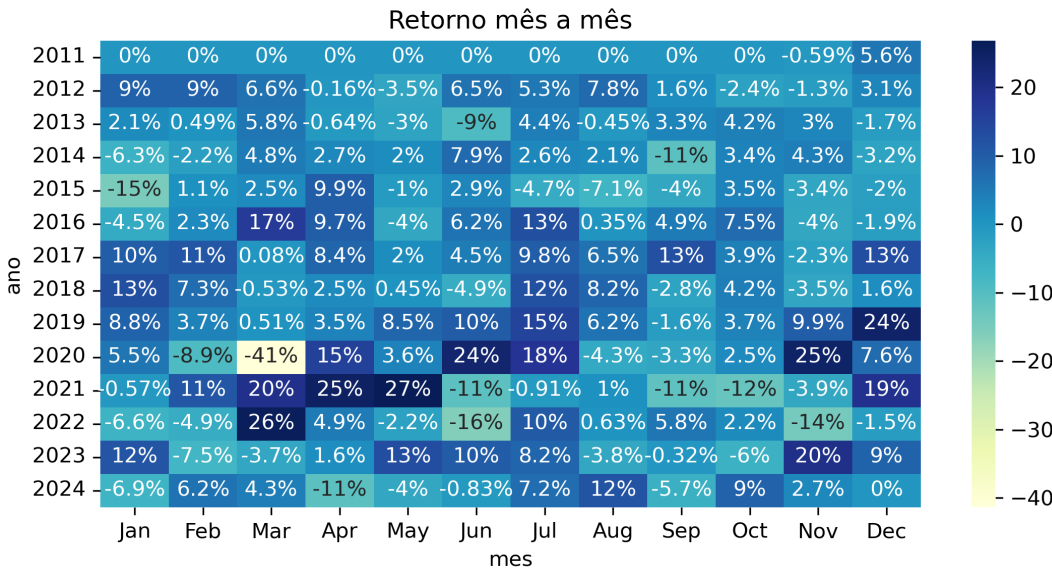
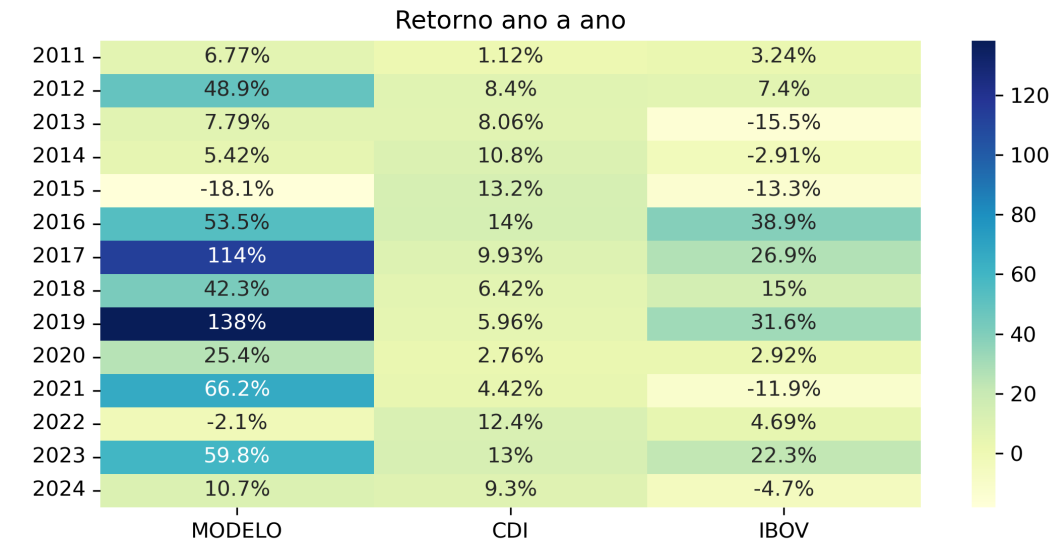
Joesley Day - 18/05/2017	-10.8%
Auge pandemia: Março - 2020	-43.63%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-5.69%
Greve dos caminhoneiros - 2018	5.38%
Precatórios - ago/nov 2021	-20.8%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-54.47%
Pior período de 3 meses	-51.93%
Pior período de 6 meses	-34.46%
Pior período de 1 ano	-23.34%
Pior período de 2 anos	-21.92%
Pior período de 3 anos	-16.74%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

