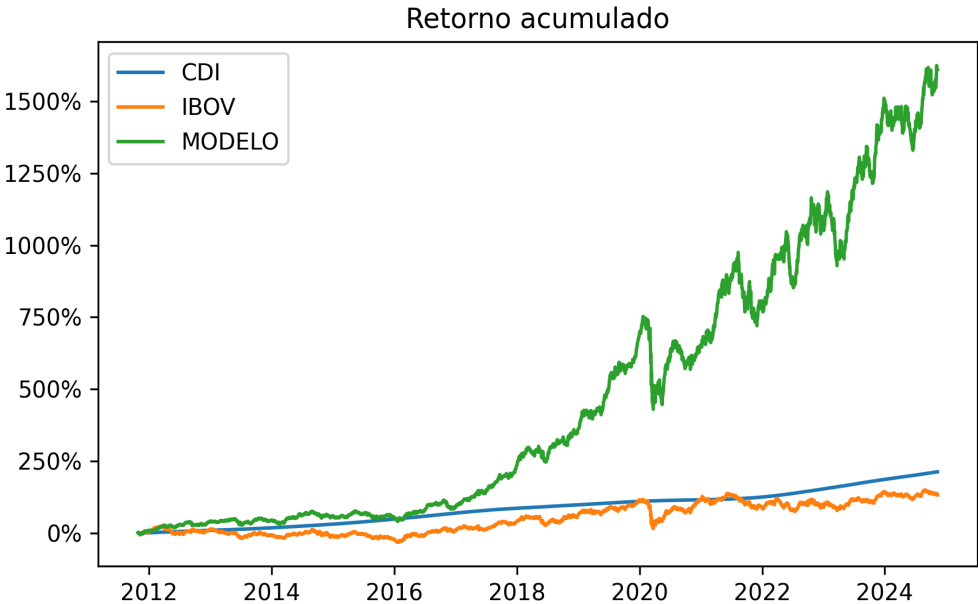


Relatório do Modelo

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



Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	1609.66%
Retorno acum. CDI	212.97%
Retorno acum. IBOV	132.62%
Retorno a.a. modelo	24.74%
Vol 252d	14.15%
Índice Sharpe	0.81
VAR diário 95%	-1.75%
Turn over carteira	23.79%
Drawdown máximo	-37.82%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	155
% Operações vencedoras	70.97%
% Operações perdedoras	29.03%
Média de ganhos	4.79%
Média de perdas	-4.75%
Expec. matemática por trade	2.02%
Maior sequência de vitória	15
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	58.33%

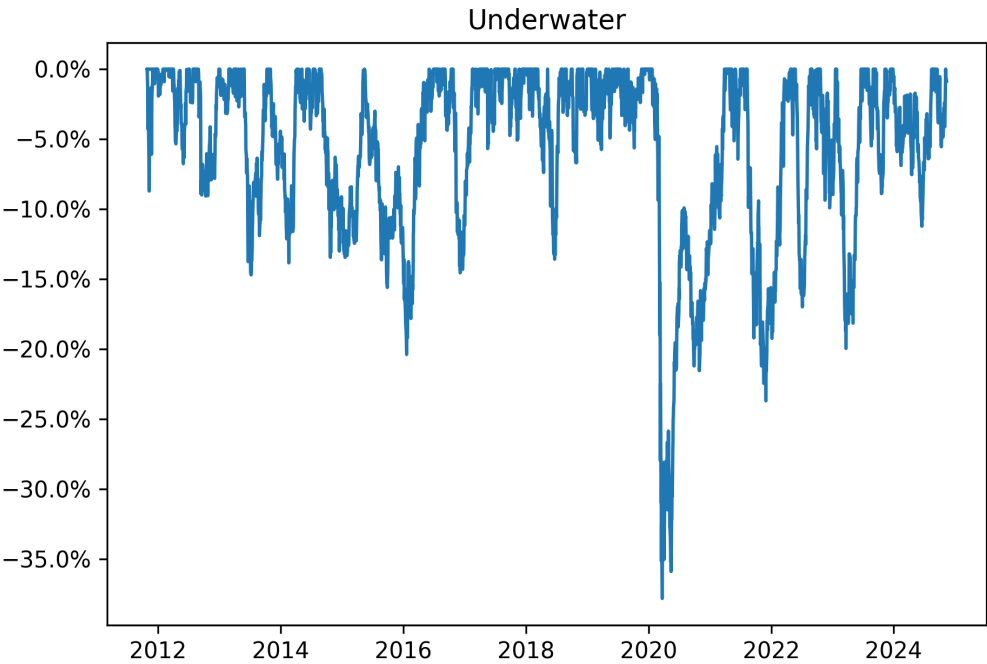
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

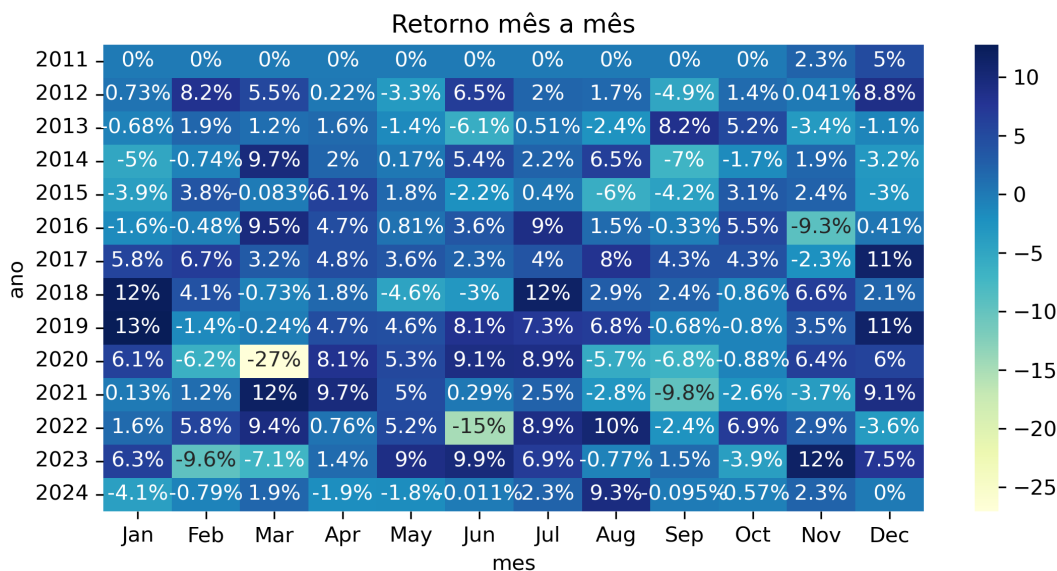
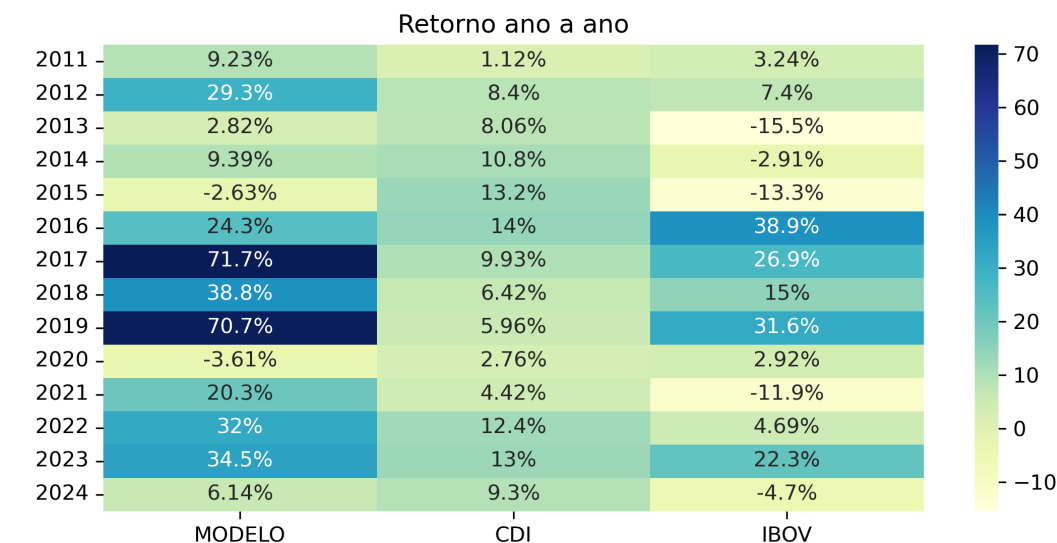
Joesley Day - 18/05/2017	-5.02%
Auge pandemia: Março - 2020	-28.46%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.54%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-0.89%
Precatórios - ago/nov 2021	-17.05%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-36.92%
Pior período de 3 meses	-34.06%
Pior período de 6 meses	-21.99%
Pior período de 1 ano	-11.87%
Pior período de 2 anos	-2.58%
Pior período de 3 anos	-0.27%

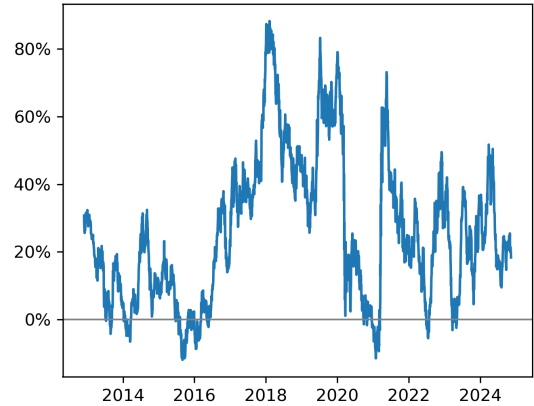


Relatório do Modelo

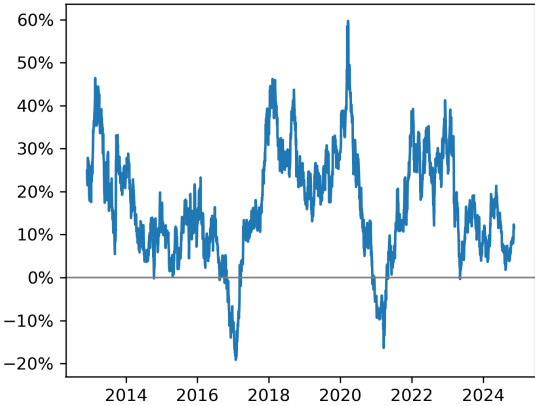


Relatório do Modelo

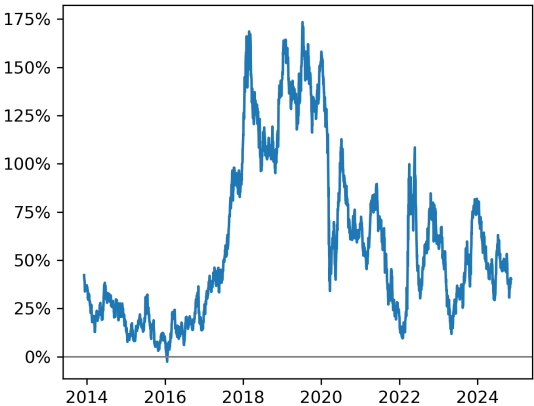
Janela móvel de retorno 12M



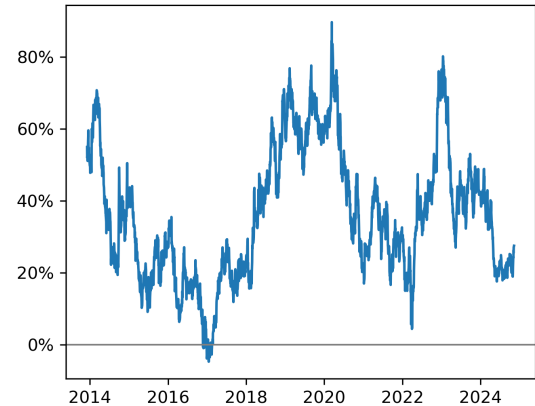
Janela móvel de alfa 12M



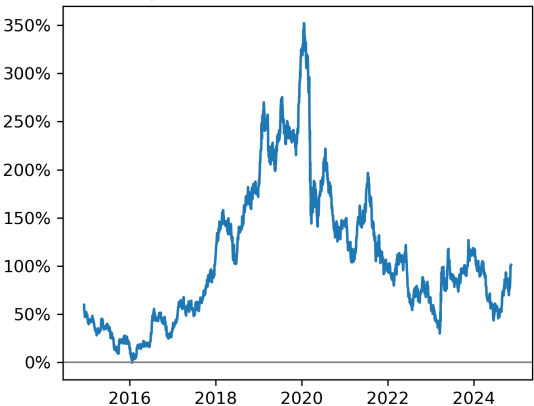
Janela móvel de retorno 24M



Janela móvel de alfa 24M



Janela móvel de retorno 36M



Janela móvel de alfa 36M

