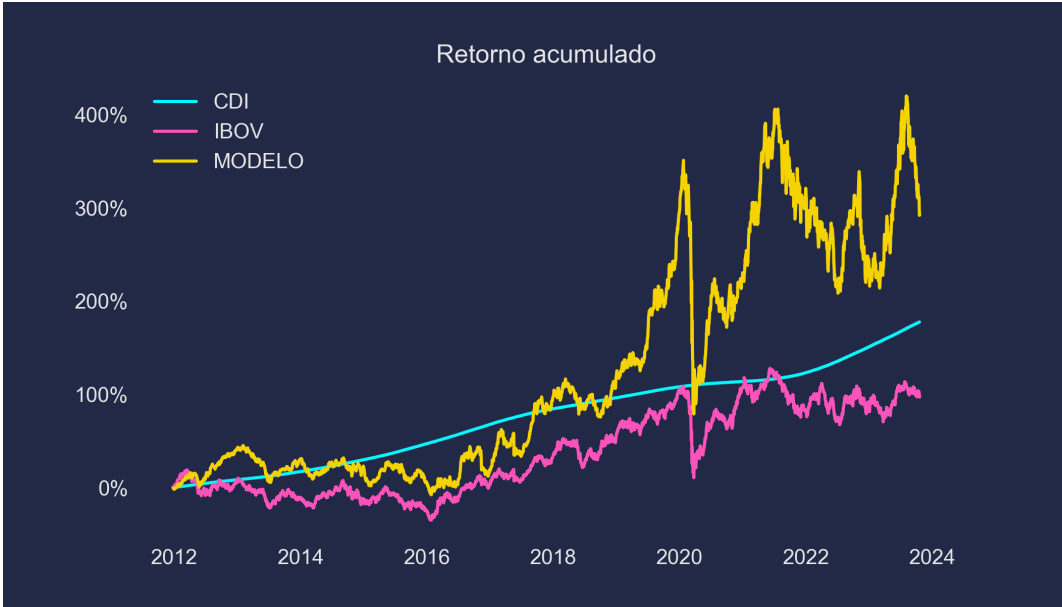


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-12-23
Dia final	2023-10-20
Dias totais	2927

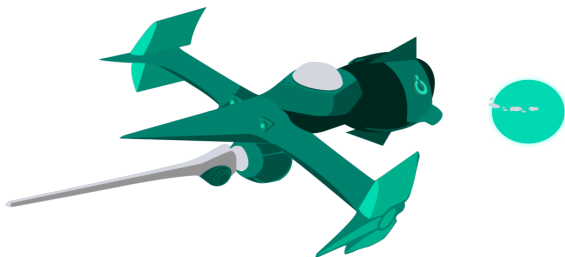


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	293.48%
Retorno acum. CDI	177.74%
Retorno acum. IBOV	97.31%
Retorno a.a. modelo	12.52%
Vol 252d	31.13%
Índice Sharpe	0.13
VAR diário 95%	-2.4%
Turn over carteira	35.33%
Drawdown máximo	-60.27%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	140
% Operações vencedoras	59.29%
% Operações perdedoras	40.71%
Média de ganhos	6.58%
Média de perdas	-6.18%
Expec. matemática por trade	1.39%
Maior sequência de vitória	8
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	54.61%



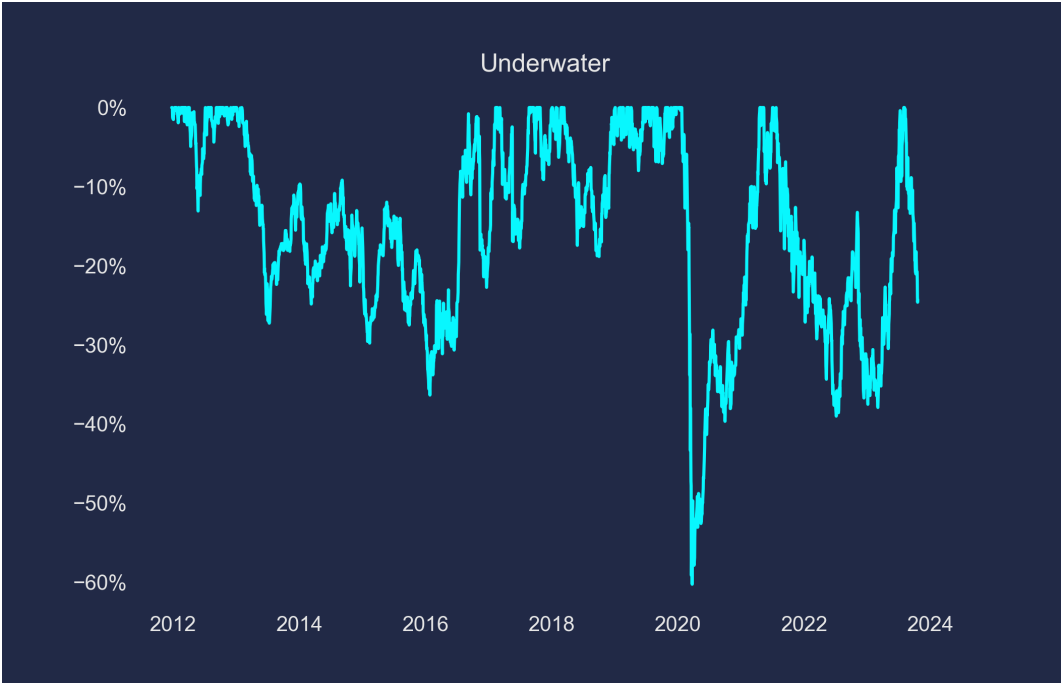
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

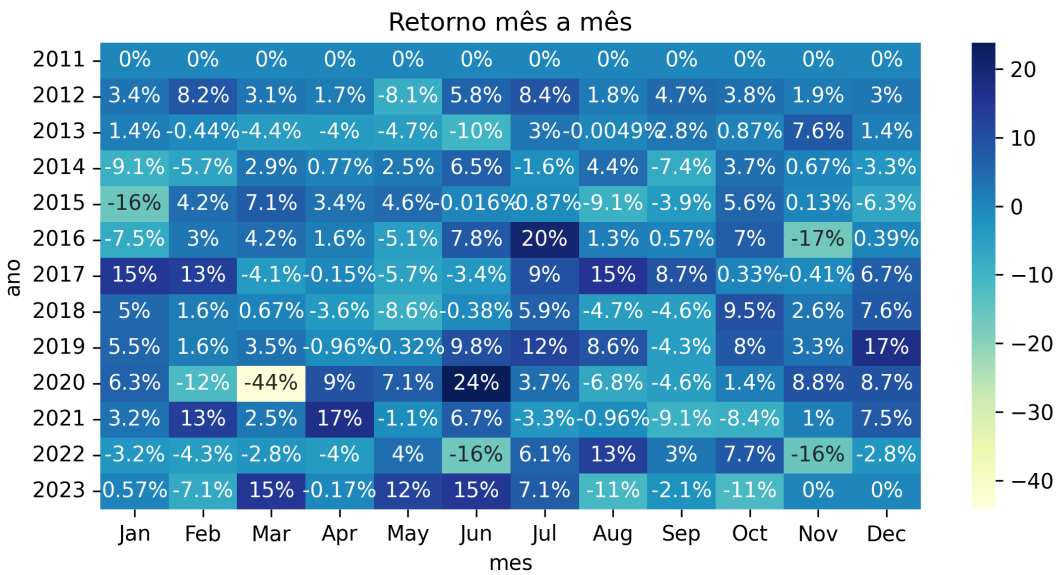
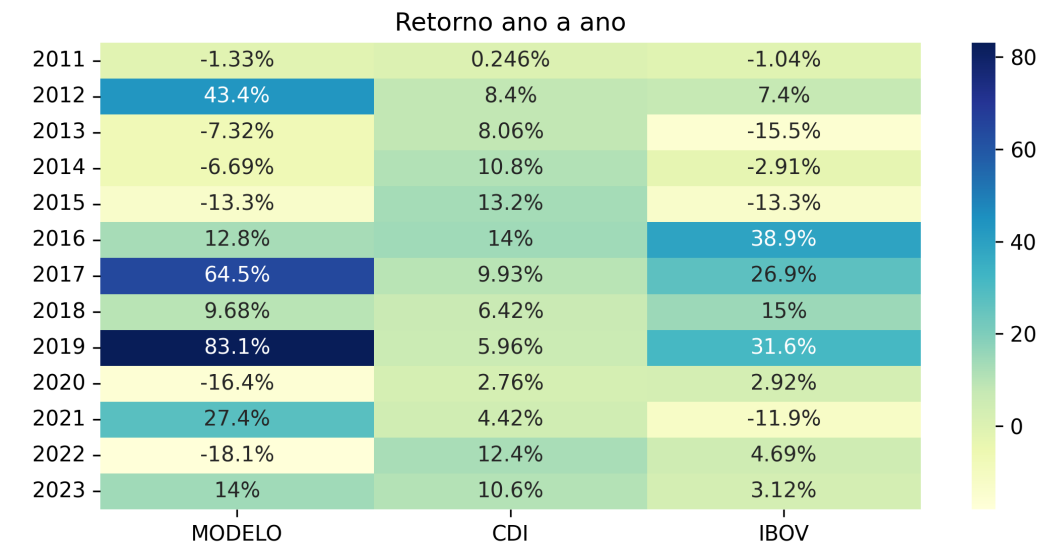
Joesley Day - 18/05/2017	-13.43%
Auge pandemia: Março - 2020	-46.3%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-8.58%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-8.82%
Precatórios - ago/nov 2021	-17.88%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-57.78%
Pior período de 3 meses	-53.71%
Pior período de 6 meses	-41.09%
Pior período de 1 ano	-38.33%
Pior período de 2 anos	-28.85%
Pior período de 3 anos	-35.27%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

