

Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-12-23
Dia final	2021-12-30
Dias totais	2476

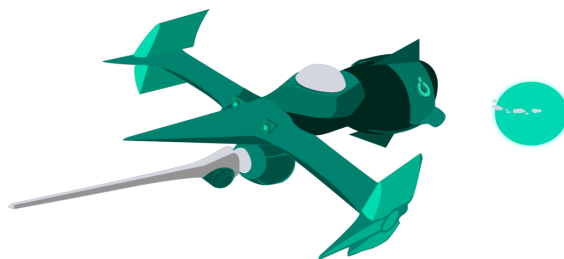


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	429.1%
Retorno acum. CDI	123.35%
Retorno acum. IBOV	82.78%
Retorno a.a. modelo	18.48%
Vol 252d	28.51%
Índice Sharpe	0.36
VAR diário 95%	-2.39%
Turn over carteira	23.22%
Drawdown máximo	-57.18%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	118
% Operações vencedoras	59.32%
% Operações perdedoras	40.68%
Média de ganhos	6.85%
Média de perdas	-5.5%
Expec. matemática por trade	1.83%
Maior sequência de vitória	12
Maior sequência de derrotas	9
% Meses carteira > IBOV	55.46%



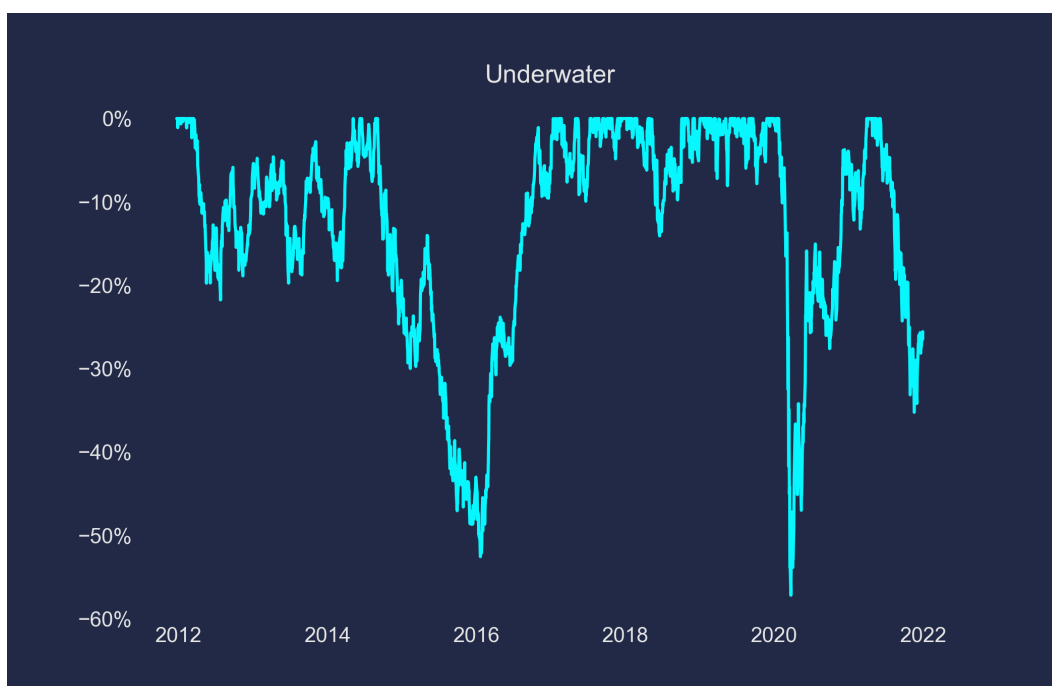
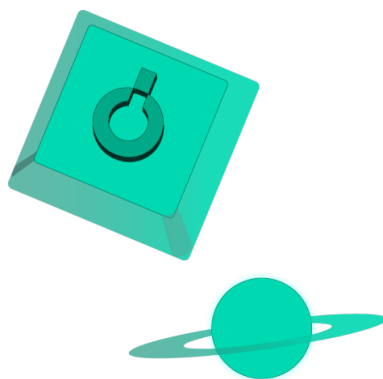
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

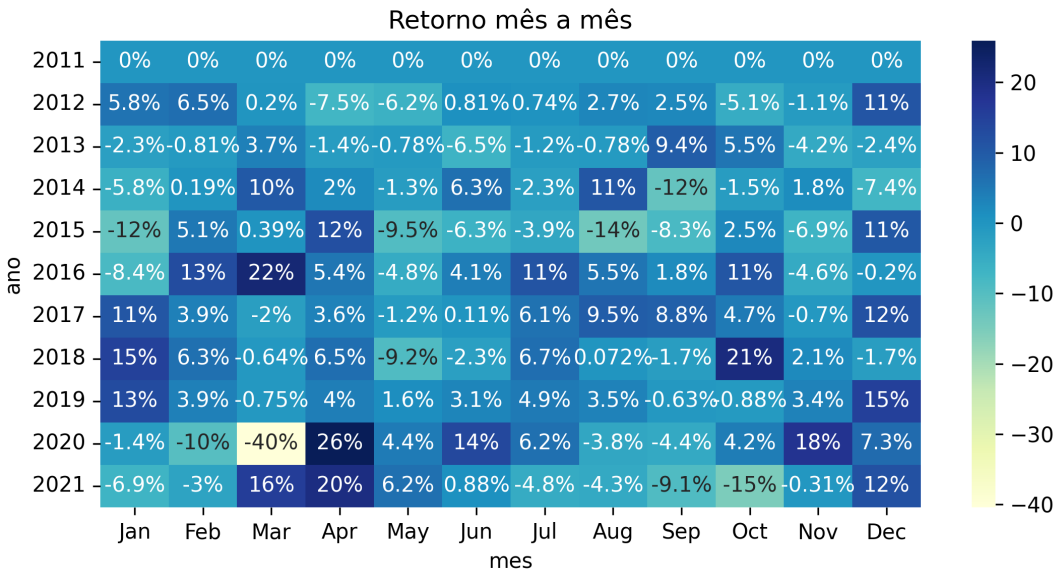
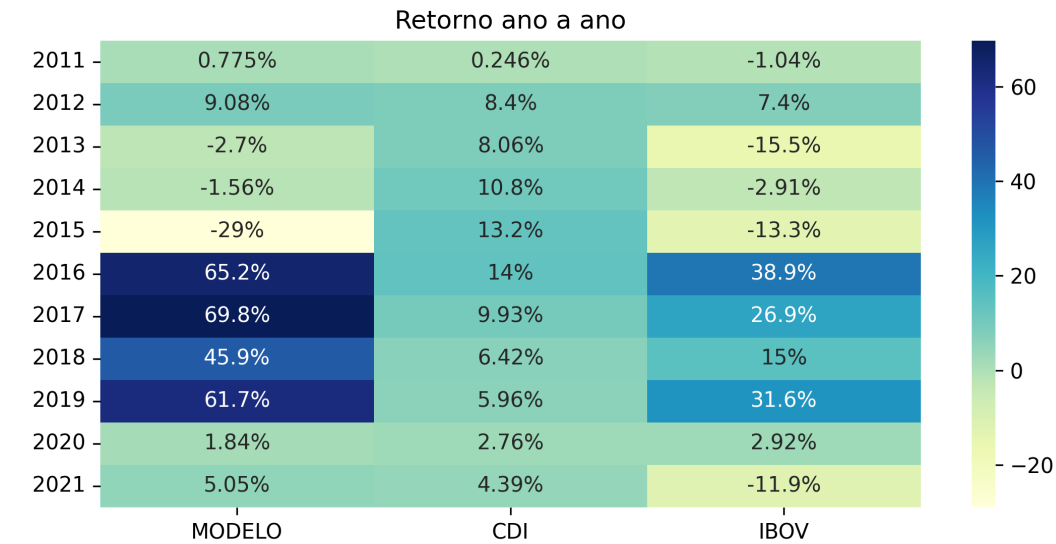
Joesley Day - 18/05/2017	-7.2%
Auge pandemia: Março - 2020	-42.08%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	-1.32%
Precatórios - ago/nov 2021	-25.18%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-54.49%
Pior período de 3 meses	-53.55%
Pior período de 6 meses	-46.99%
Pior período de 1 ano	-43.12%
Pior período de 2 anos	-40.93%
Pior período de 3 anos	-44.02%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

