

# Relatório do Modelo

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

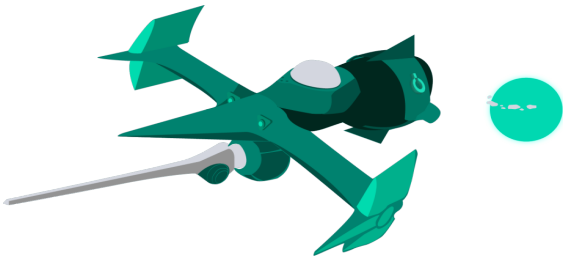


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	374.75%
Retorno acum. CDI	177.74%
Retorno acum. IBOV	97.31%
Retorno a.a. modelo	14.35%
Vol 252d	38.82%
Índice Sharpe	0.18
VAR diário 95%	-2.52%
Turn over carteira	58.31%
Drawdown máximo	-54.84%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	140
% Operações vencedoras	55.0%
% Operações perdedoras	45.0%
Média de ganhos	8.1%
Média de perdas	-6.33%
Expec. matemática por trade	1.61%
Maior sequência de vitória	12
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	48.94%



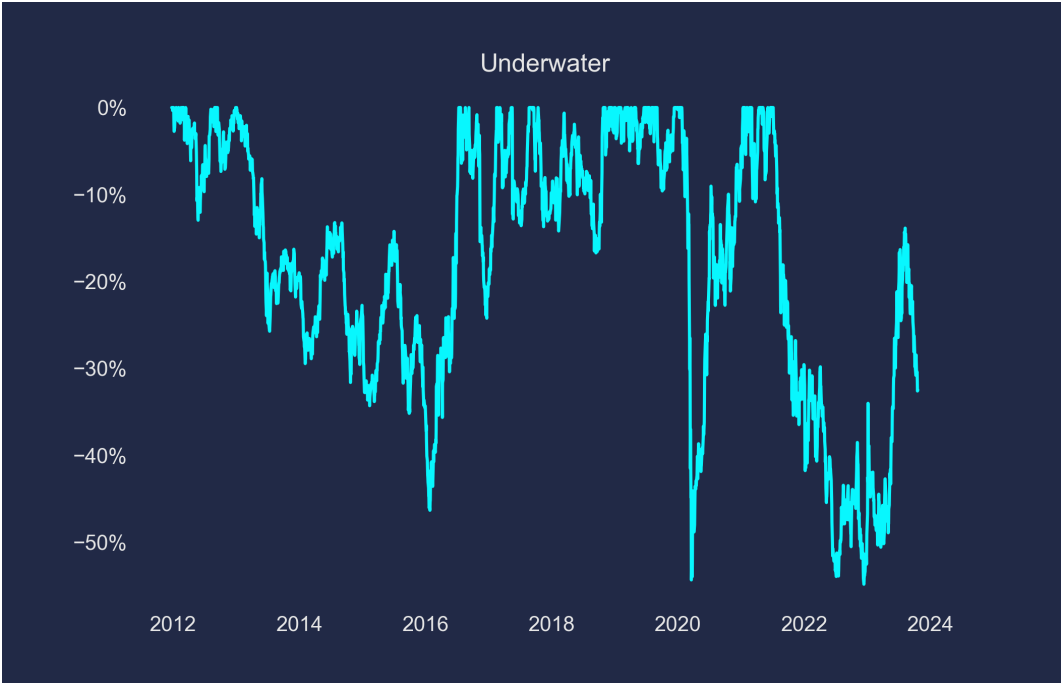
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

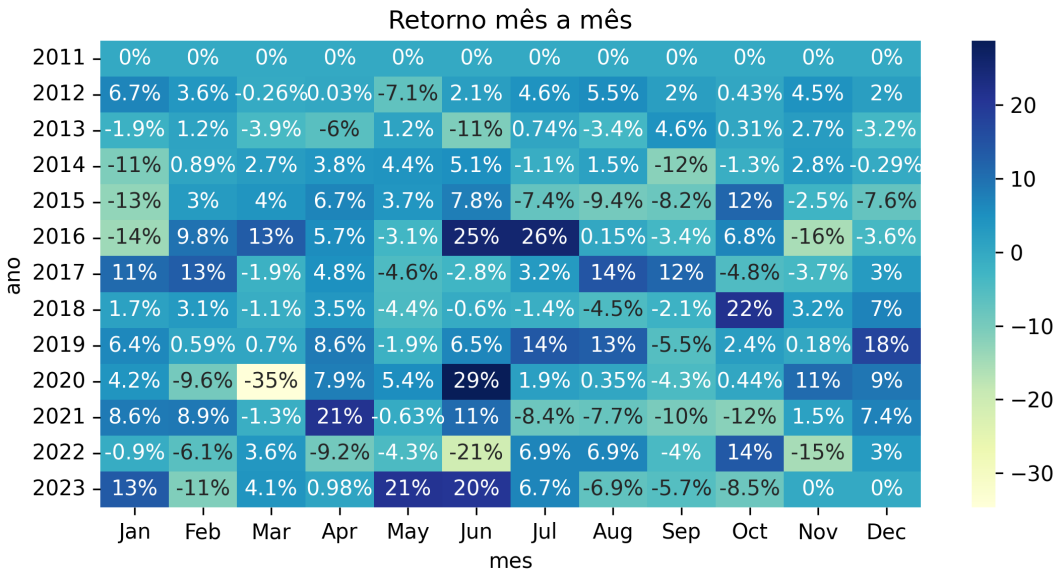
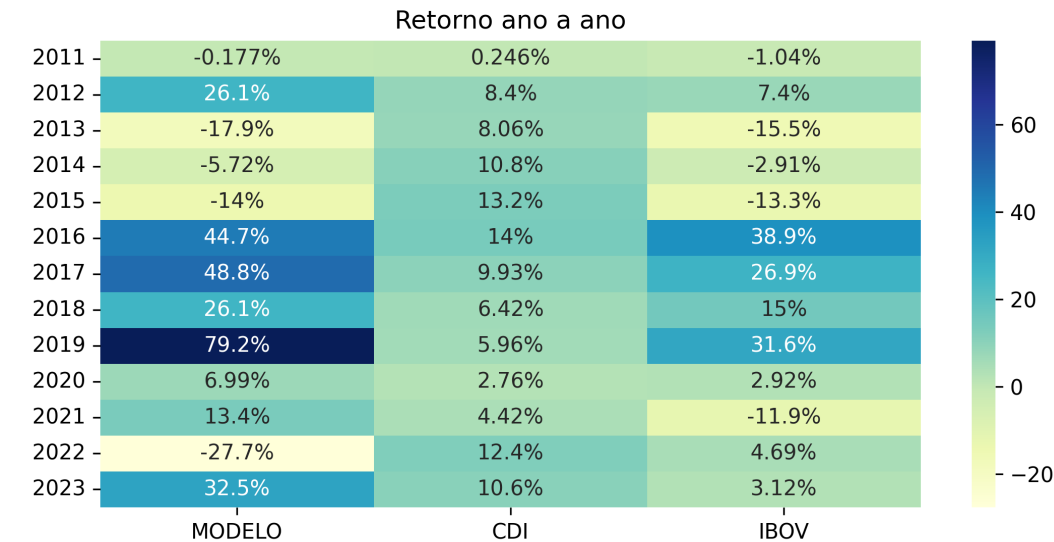
Joesley Day - 18/05/2017	-10.98%
Auge pandemia: Março - 2020	-37.54%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-6.37%
Greve dos caminhoneiros - 2018	1.31%
Precatórios - ago/nov 2021	-24.09%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-52.29%
Pior período de 3 meses	-46.28%
Pior período de 6 meses	-41.76%
Pior período de 1 ano	-52.46%
Pior período de 2 anos	-38.59%
Pior período de 3 anos	-46.19%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

