

## Relatório do Modelo

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

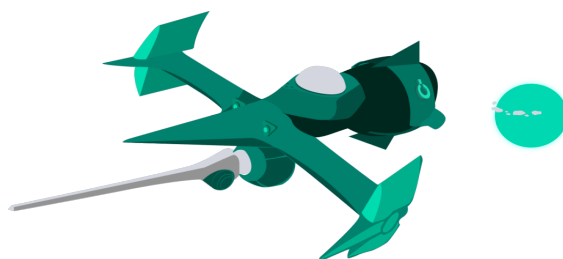


### Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	967.02%
Retorno acum. CDI	123.35%
Retorno acum. IBOV	82.78%
Retorno a.a. modelo	27.25%
Vol 252d	37.09%
Índice Sharpe	0.59
VAR diário 95%	-2.67%
Turn over carteira	73.37%
Drawdown máximo	-61.71%

### Estatísticas de Trade

Número de carteiras	118
% Operações vencedoras	66.1%
% Operações perdedoras	33.9%
Média de ganhos	7.45%
Média de perdas	-6.99%
Expec. matemática por trade	2.55%
Maior sequência de vitória	14
Maior sequência de derrotas	7
% Meses carteira > IBOV	59.66%



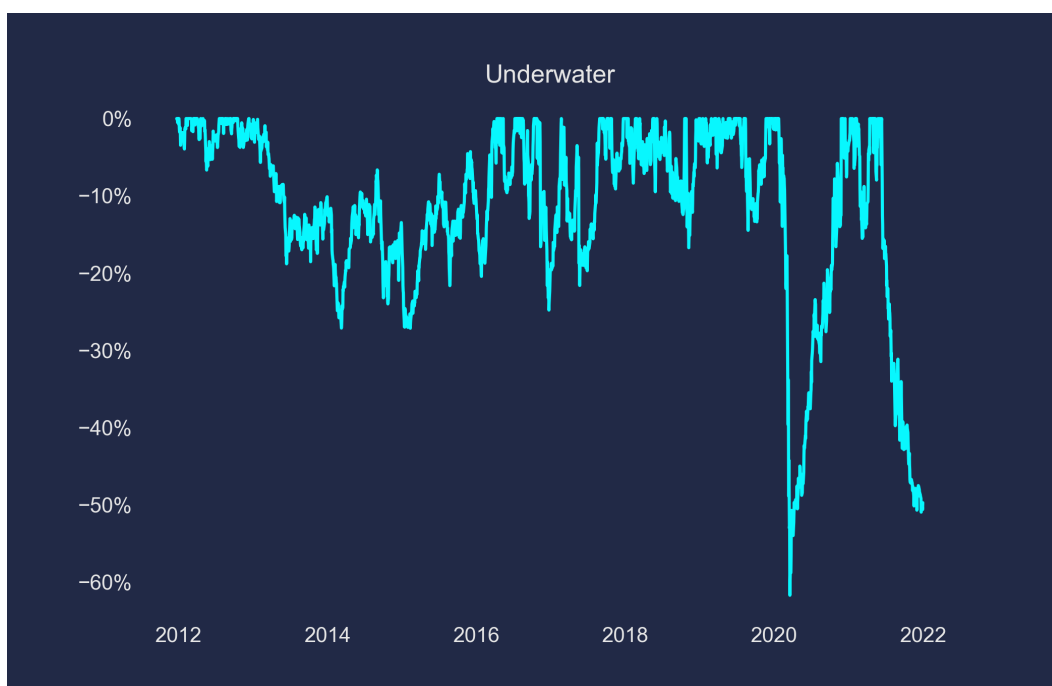
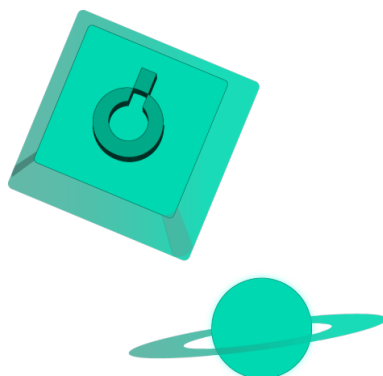
## Relatório do Modelo

### Eventos de estresse

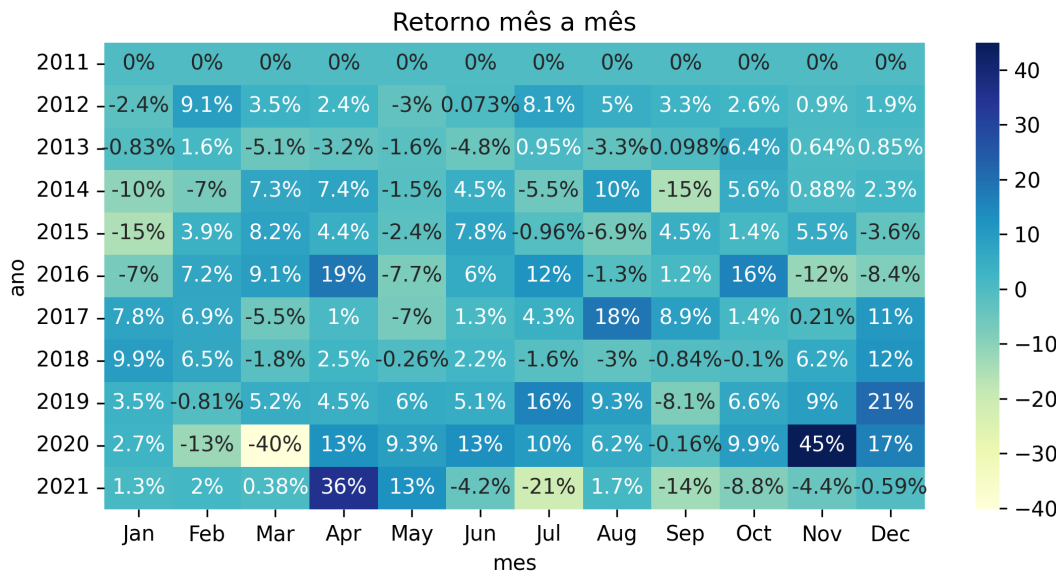
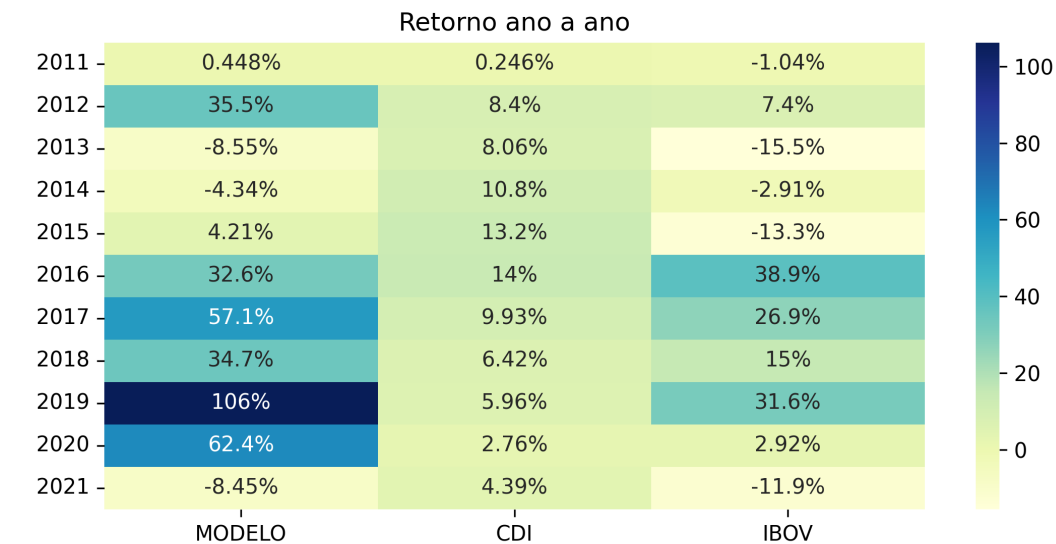
Joesley Day - 18/05/2017	-13.0%
Auge pandemia: Março - 2020	-43.13%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	5.27%
Precatórios - ago/nov 2021	-22.32%
Crise de 2008	-

### Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-58.59%
Pior período de 3 meses	-53.41%
Pior período de 6 meses	-48.05%
Pior período de 1 ano	-25.56%
Pior período de 2 anos	-26.74%
Pior período de 3 anos	-20.16%



# Relatório do Modelo



## Relatório do Modelo

