

Relatório do Modelo

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

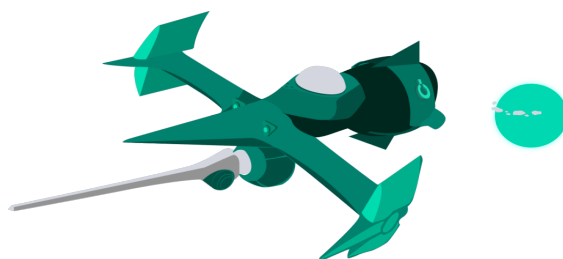


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	2475.32%
Retorno acum. CDI	123.35%
Retorno acum. IBOV	82.78%
Retorno a.a. modelo	39.18%
Vol 252d	33.98%
Índice Sharpe	1.11
VAR diário 95%	-2.26%
Turn over carteira	55.3%
Drawdown máximo	-61.69%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	118
% Operações vencedoras	63.56%
% Operações perdedoras	36.44%
Média de ganhos	8.42%
Média de perdas	-5.5%
Expec. matemática por trade	3.35%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	69.75%



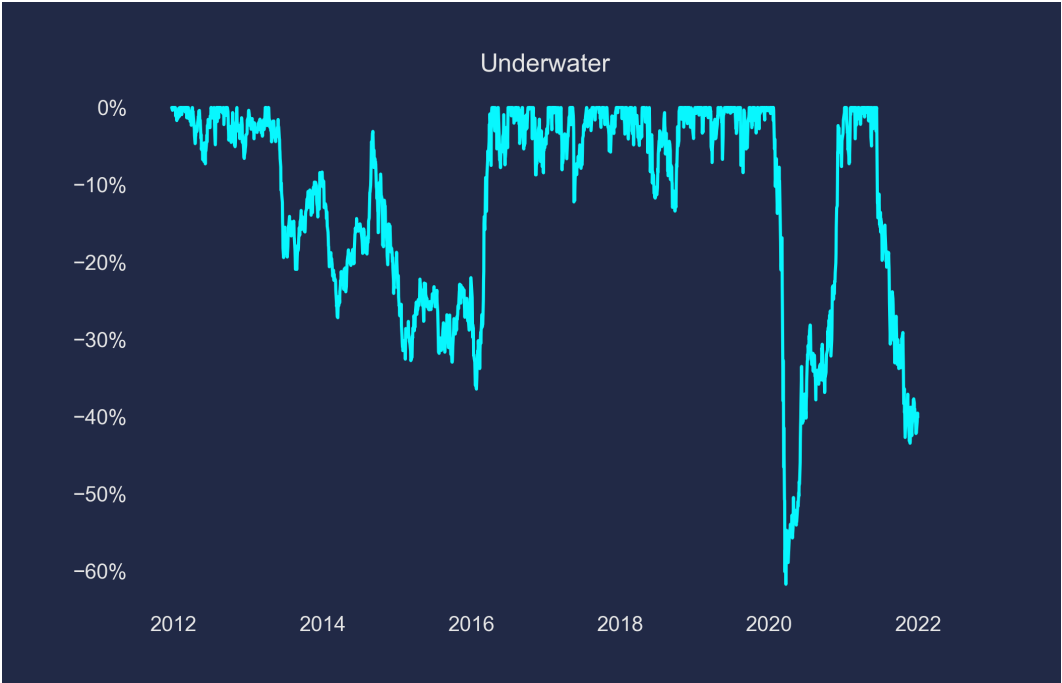
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

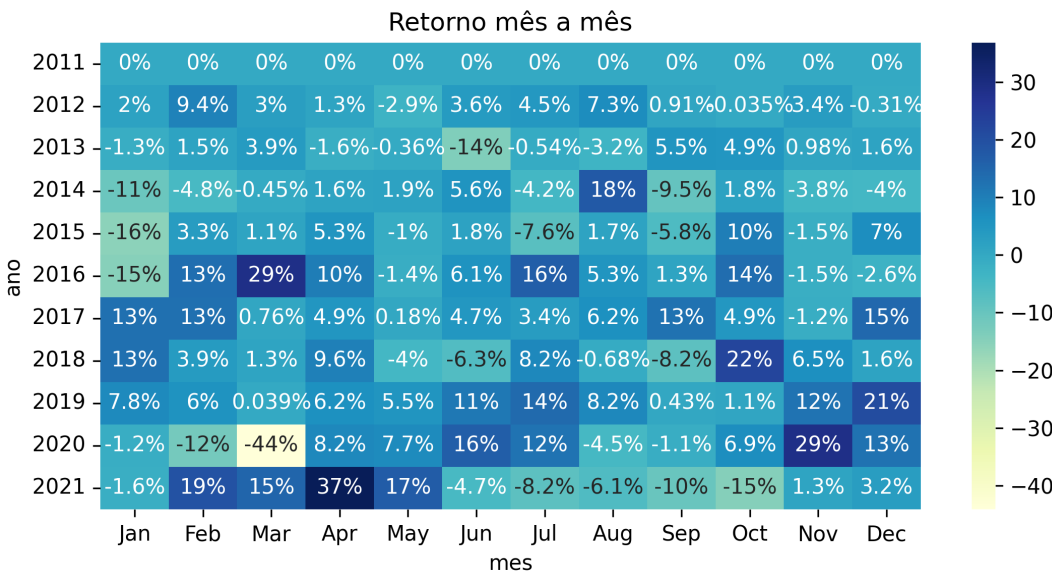
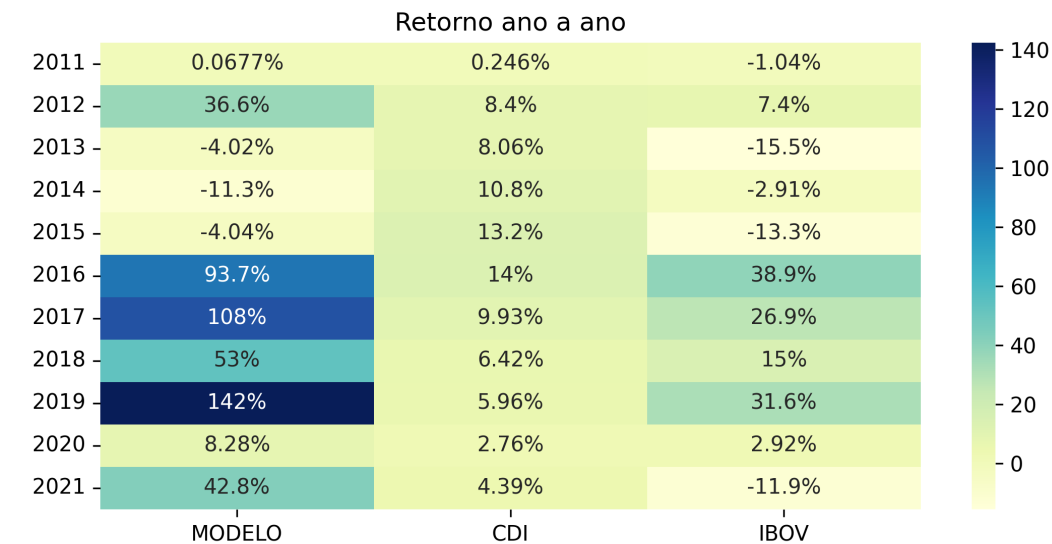
Joesley Day - 18/05/2017	-9.25%
Auge pandemia: Março - 2020	-46.49%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	6.15%
Precatórios - ago/nov 2021	-27.49%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-58.49%
Pior período de 3 meses	-56.26%
Pior período de 6 meses	-39.81%
Pior período de 1 ano	-28.88%
Pior período de 2 anos	-29.45%
Pior período de 3 anos	-34.23%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

