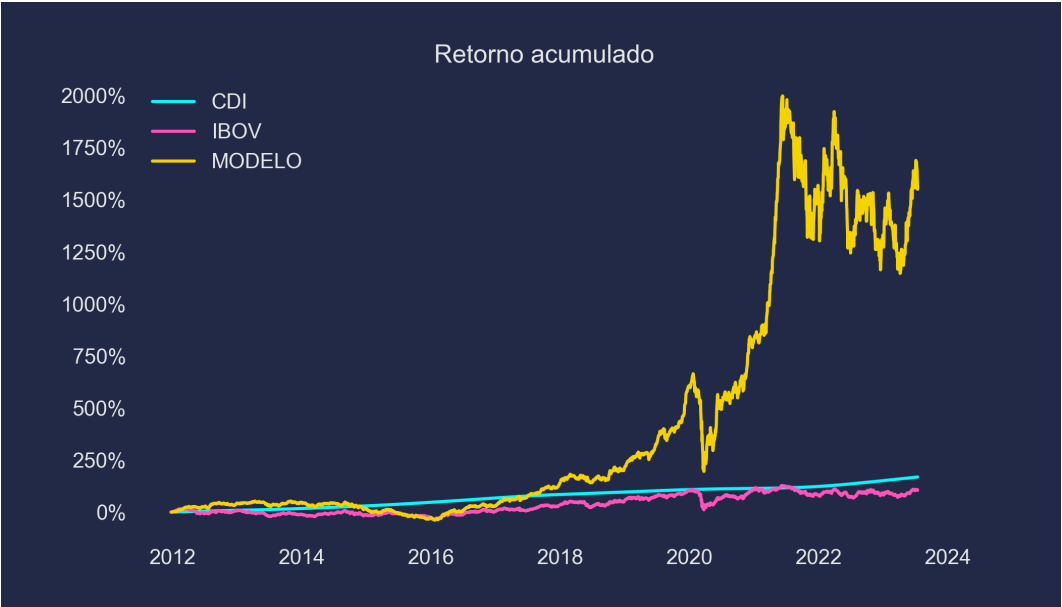


# Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-12-23
Dia final	2023-07-14
Dias totais	2860

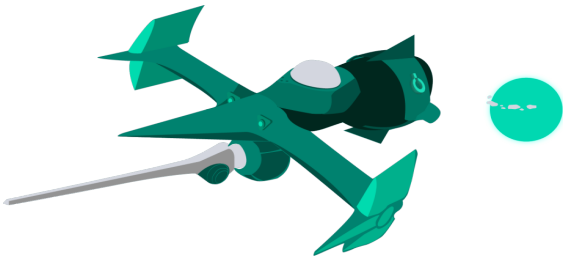


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	1549.81%
Retorno acum. CDI	168.8%
Retorno acum. IBOV	105.26%
Retorno a.a. modelo	28.02%
Vol 252d	31.34%
Índice Sharpe	0.63
VAR diário 95%	-2.64%
Turn over carteira	28.32%
Drawdown máximo	-61.34%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	137
% Operações vencedoras	58.39%
% Operações perdedoras	41.61%
Média de ganhos	8.72%
Média de perdas	-5.96%
Expec. matemática por trade	2.61%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	8
% Meses carteira > IBOV	59.42%



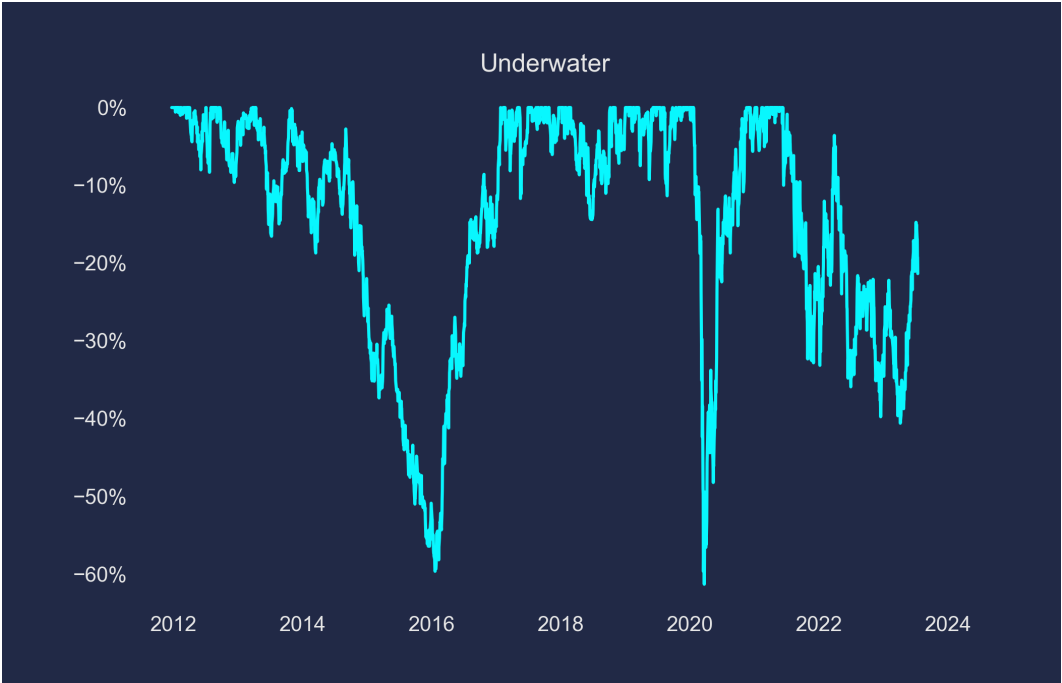
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

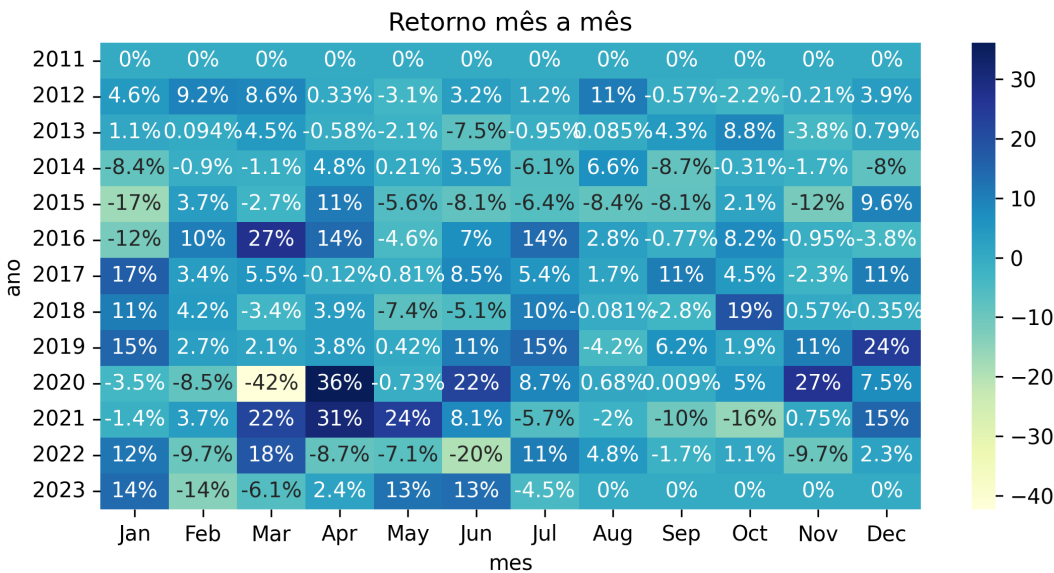
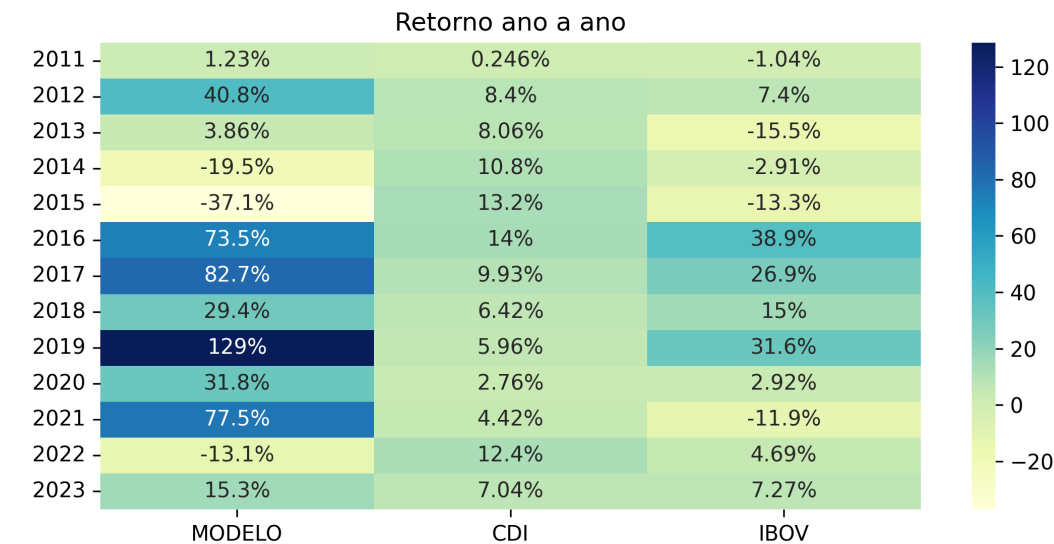
Joesley Day - 18/05/2017	-9.11%
Auge pandemia: Março - 2020	-43.87%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-4.05%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-3.19%
Precatórios - ago/nov 2021	-23.52%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-56.95%
Pior período de 3 meses	-56.3%
Pior período de 6 meses	-40.03%
Pior período de 1 ano	-48.25%
Pior período de 2 anos	-57.5%
Pior período de 3 anos	-56.86%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

