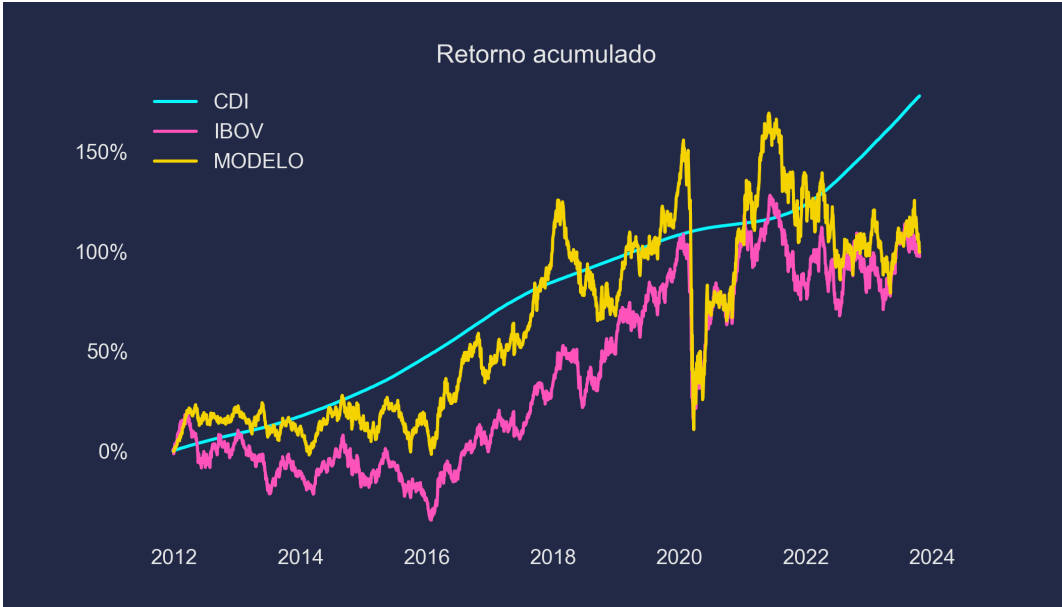


Relatório do Modelo

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

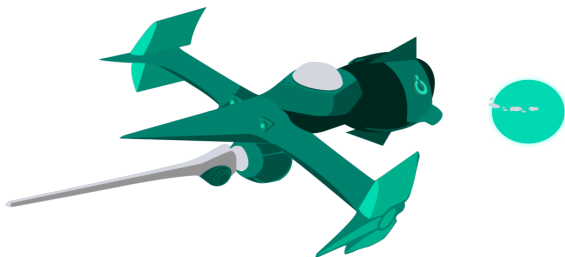


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	99.49%
Retorno acum. CDI	177.74%
Retorno acum. IBOV	97.31%
Retorno a.a. modelo	6.13%
Vol 252d	18.54%
Índice Sharpe	-0.13
VAR diário 95%	-2.09%
Turn over carteira	9.29%
Drawdown máximo	-56.7%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	140
% Operações vencedoras	59.29%
% Operações perdedoras	40.71%
Média de ganhos	4.39%
Média de perdas	-4.57%
Expec. matemática por trade	0.74%
Maior sequência de vitória	7
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	50.35%



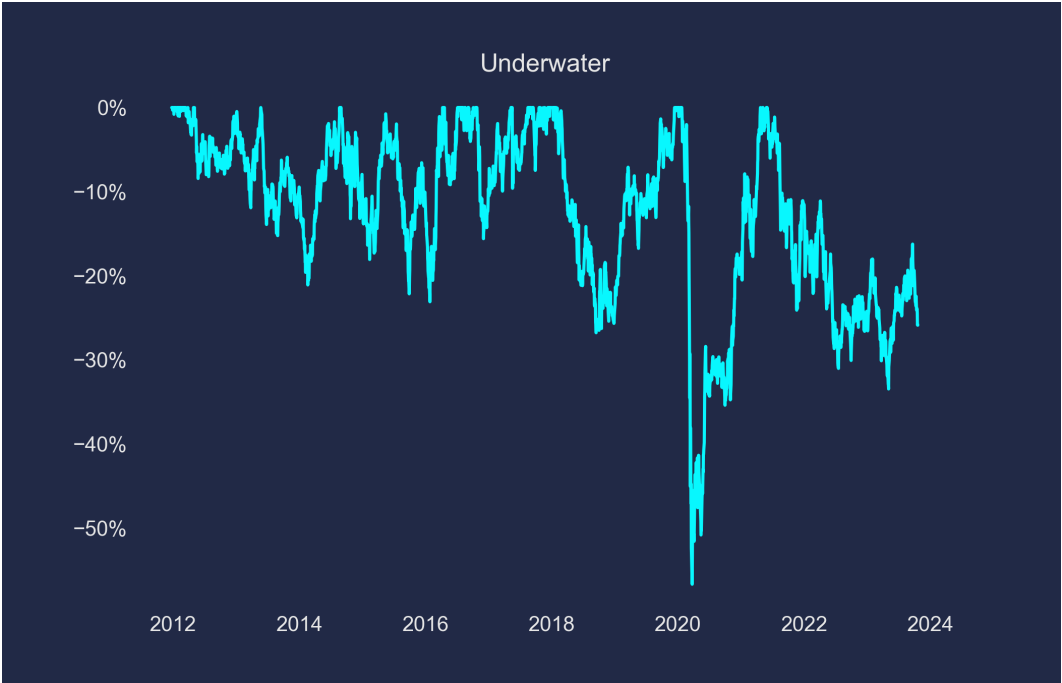
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

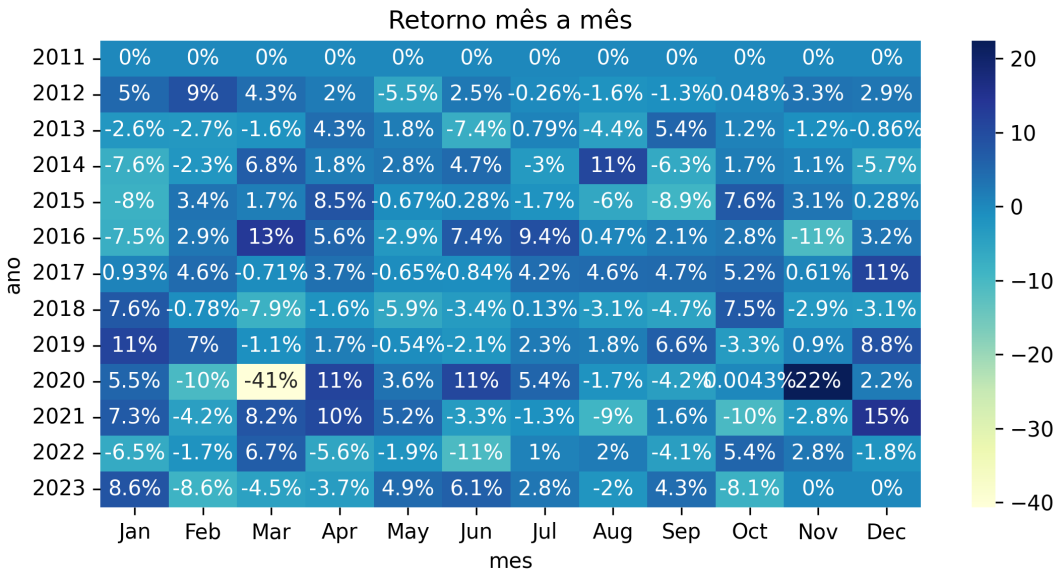
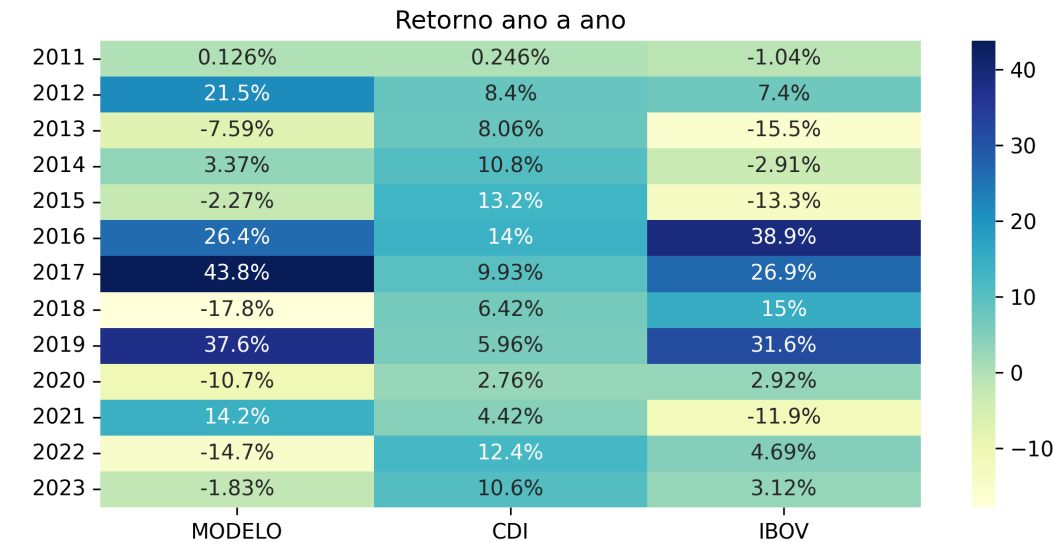
Joesley Day - 18/05/2017	-6.95%
Auge pandemia: Março - 2020	-41.86%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-2.64%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-5.1%
Precatórios - ago/nov 2021	-16.35%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-55.8%
Pior período de 3 meses	-51.37%
Pior período de 6 meses	-48.48%
Pior período de 1 ano	-47.02%
Pior período de 2 anos	-46.43%
Pior período de 3 anos	-26.98%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

