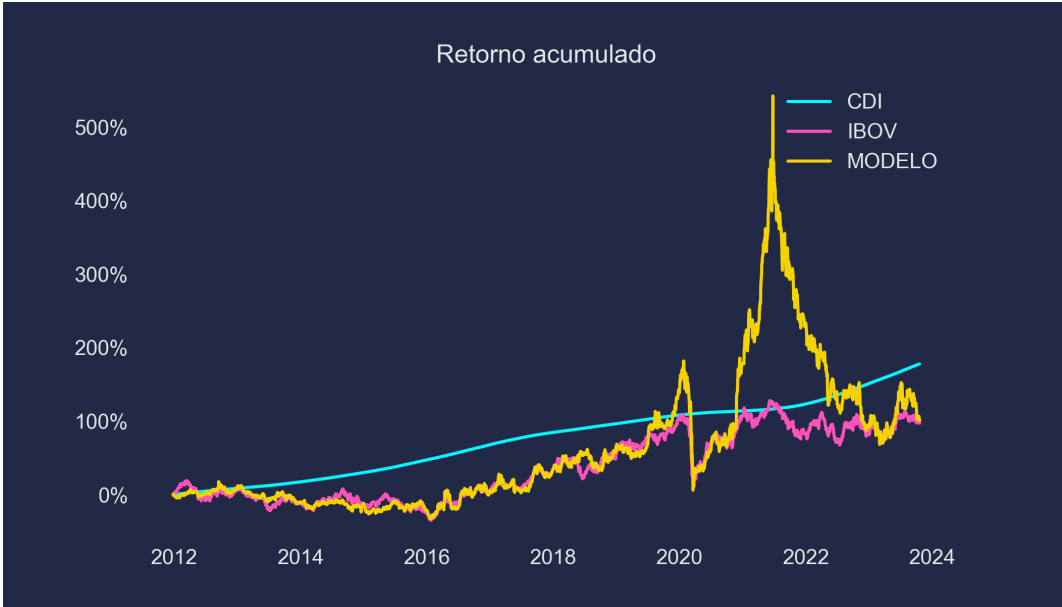


Relatório do Modelo

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

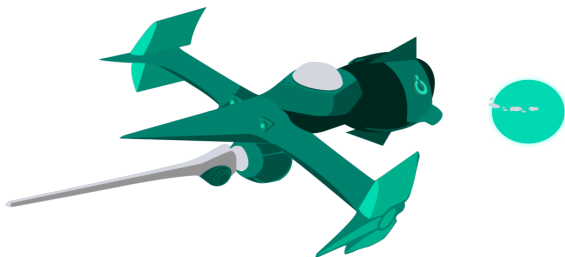


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	101.27%
Retorno acum. CDI	177.74%
Retorno acum. IBOV	97.31%
Retorno a.a. modelo	6.21%
Vol 252d	33.04%
Índice Sharpe	-0.1
VAR diário 95%	-2.65%
Turn over carteira	83.0%
Drawdown máximo	-73.8%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	140
% Operações vencedoras	52.86%
% Operações perdedoras	47.14%
Média de ganhos	7.46%
Média de perdas	-6.27%
Expec. matemática por trade	0.99%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	9
% Meses carteira > IBOV	46.1%



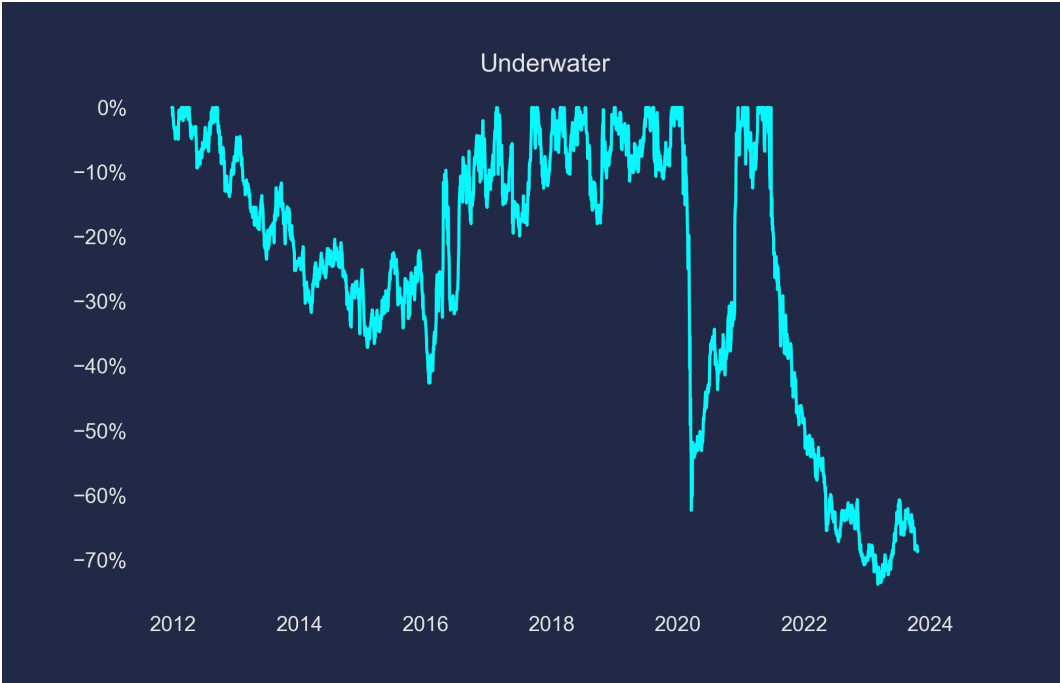
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

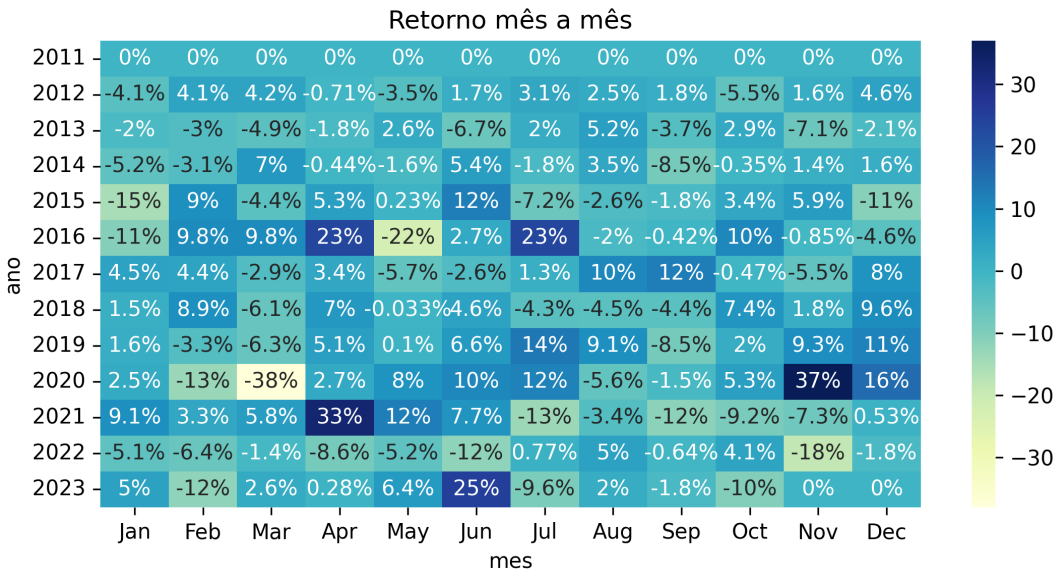
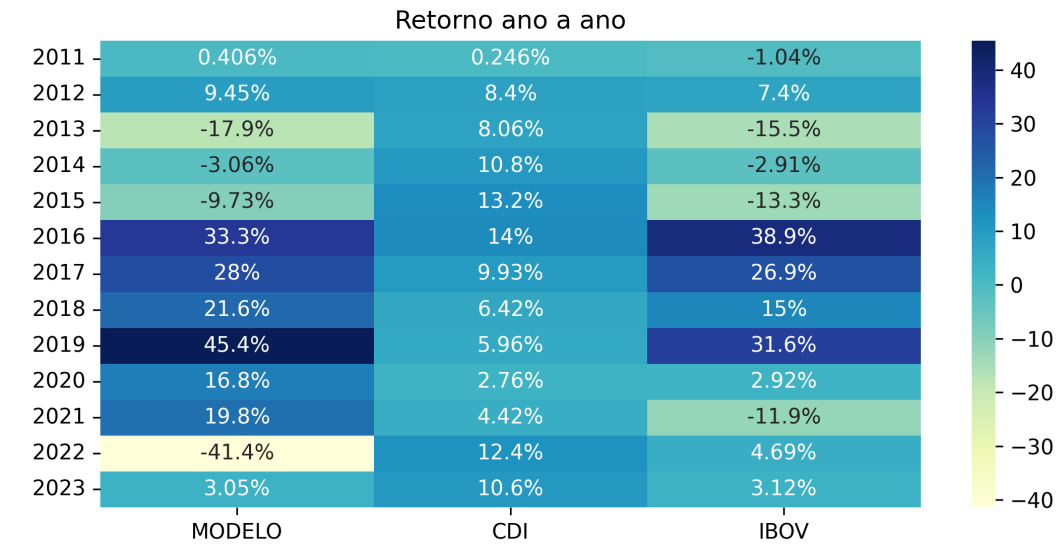
Joesley Day - 18/05/2017	-11.68%
Auge pandemia: Março - 2020	-41.51%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.96%
Greve dos caminhoneiros - 2018	7.84%
Precatórios - ago/nov 2021	-25.54%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-58.12%
Pior período de 3 meses	-53.55%
Pior período de 6 meses	-48.61%
Pior período de 1 ano	-62.82%
Pior período de 2 anos	-61.41%
Pior período de 3 anos	-39.16%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

