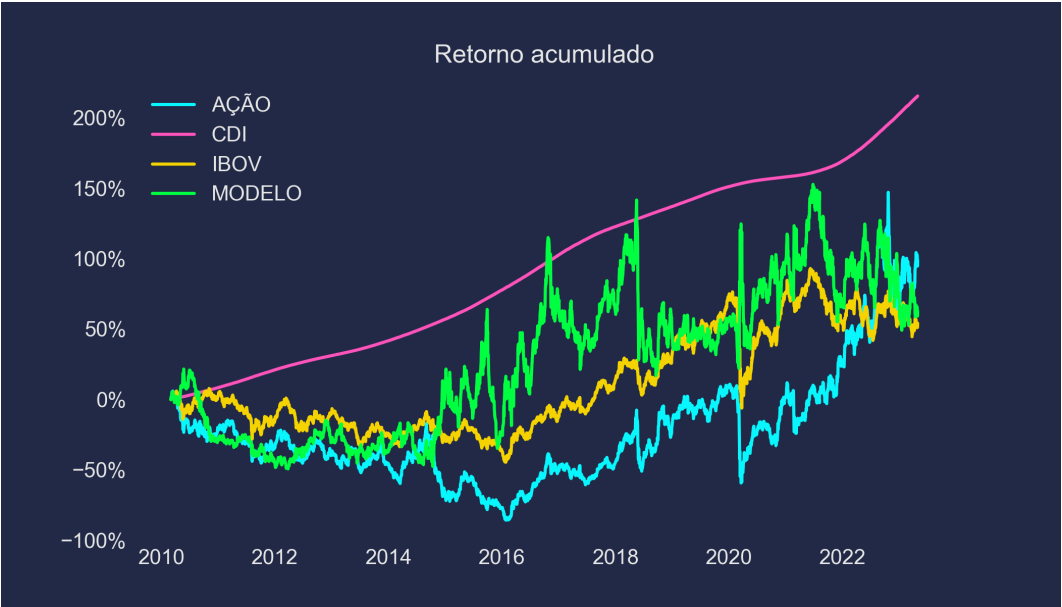


Relatório do Modelo

Dia inicial	2010-03-03
Dia final	2023-04-28
Dias totais	3260

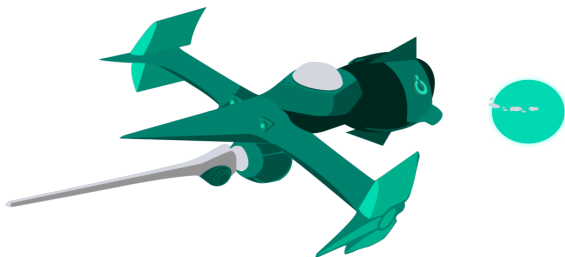


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	62.37%
Retorno acum. ativo	98.71%
Retorno acum. CDI	215.52%
Retorno acum. IBOV	54.08%
Retorno a.a. modelo	3.82%
Vol 252d	41.06%
Índice Sharpe	-0.12
VAR diário 95%	-4.35%
Drawdown máximo	-60.25%

Estatísticas de Trade

Número de trades	108
% Operações vencedoras	36.11%
% Operações perdedoras	63.89%
Média de ganhos	15.16%
Média de perdas	-6.52%
Expec. matemática por trade	1.31%
Tempo médio de operação	30
Maior sequência de vitória	4
Maior sequência de derrotas	8

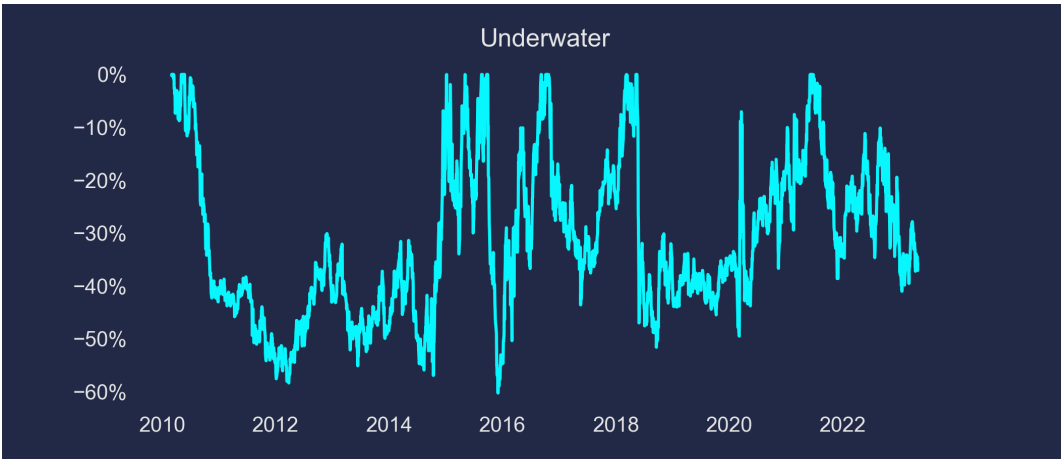
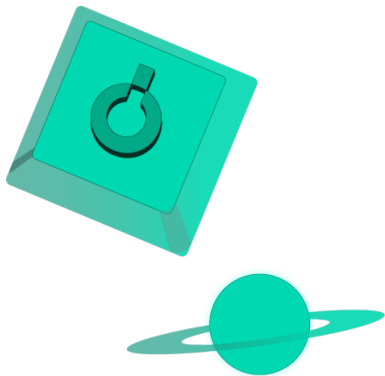


Relatório do Modelo



Eventos de estresse

Joesley Day - 18/05/2017	-15.76%
Auge pandemia: Março - 2020	39.78%
Boa sorte Day - 10/11/2022	2.93%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-35.05%
Precatórios - ago/nov 2021	-19.74%
Crise de 2008	-



Relatório do Modelo

