

Relatório do Modelo

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

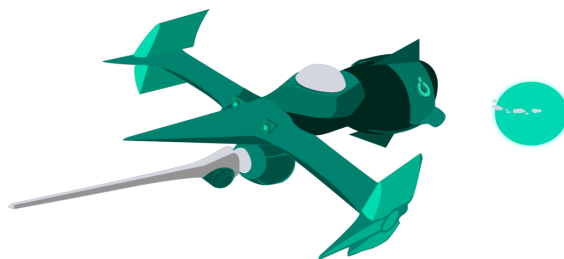


Estatísticas de Retorno e Risco

| | |
|----------------------|---------|
| Retorno acum. modelo | 429.1% |
| Retorno acum. CDI | 123.35% |
| Retorno acum. IBOV | 82.78% |
| Retorno a.a. modelo | 18.48% |
| Vol 252d | 28.51% |
| Índice Sharpe | 0.36 |
| VAR diário 95% | -2.39% |
| Turn over carteira | 23.22% |
| Drawdown máximo | -57.18% |

Estatísticas de Trade

| | |
|-----------------------------|--------|
| Número de carteiras | 118 |
| % Operações vencedoras | 59.32% |
| % Operações perdedoras | 40.68% |
| Média de ganhos | 6.85% |
| Média de perdas | -5.5% |
| Expec. matemática por trade | 1.83% |
| Maior sequência de vitória | 12 |
| Maior sequência de derrotas | 9 |
| % Meses carteira > IBOV | 55.46% |



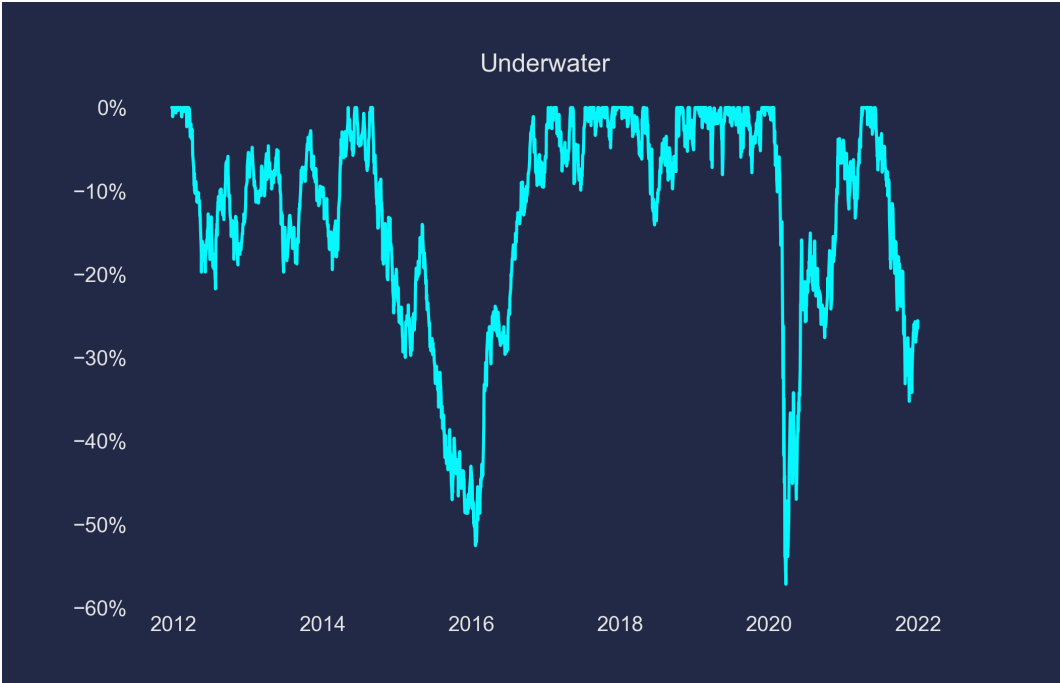
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

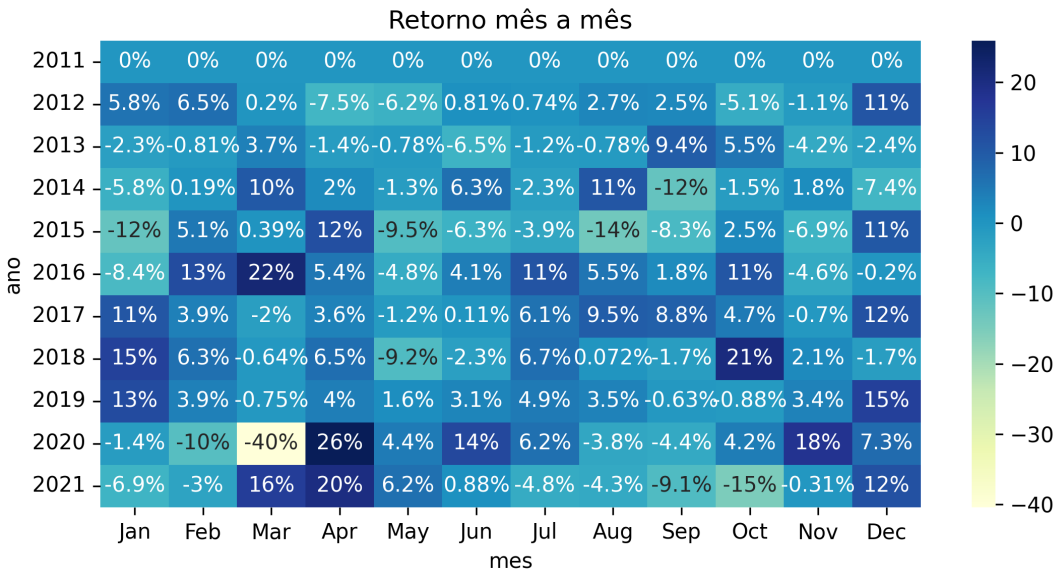
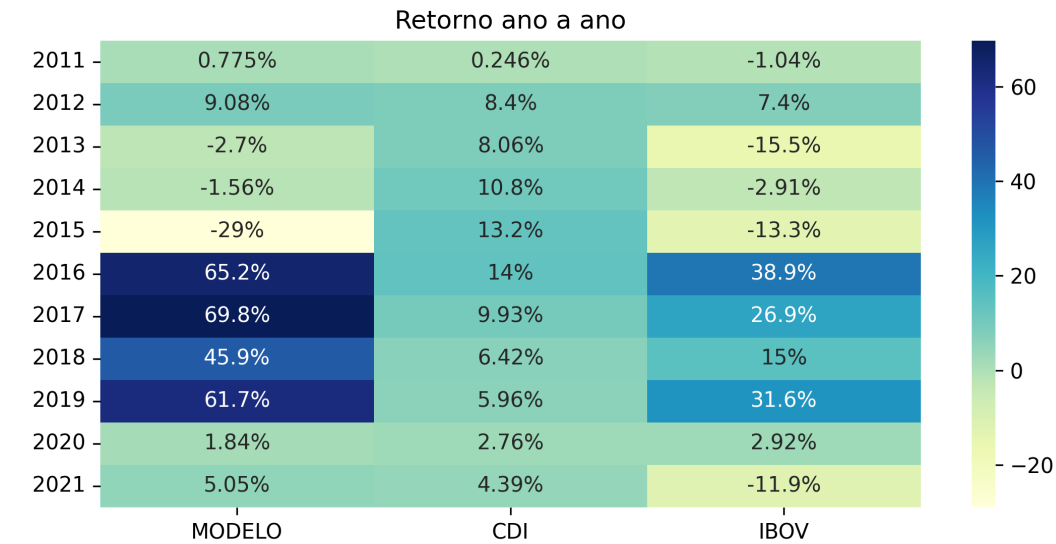
| | |
|--------------------------------|---------|
| Joesley Day - 18/05/2017 | -7.2% |
| Auge pandemia: Março - 2020 | -42.08% |
| Boa sorte Day - 10/11/2022 | - |
| Greve dos caminhoneiros - 2018 | -1.32% |
| Precatórios - ago/nov 2021 | -25.18% |
| Crise de 2008 | - |

Períodos sem lucro

| | |
|-------------------------|---------|
| Pior período de 1 mês | -54.49% |
| Pior período de 3 meses | -53.55% |
| Pior período de 6 meses | -46.99% |
| Pior período de 1 ano | -43.12% |
| Pior período de 2 anos | -40.93% |
| Pior período de 3 anos | -44.02% |



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

