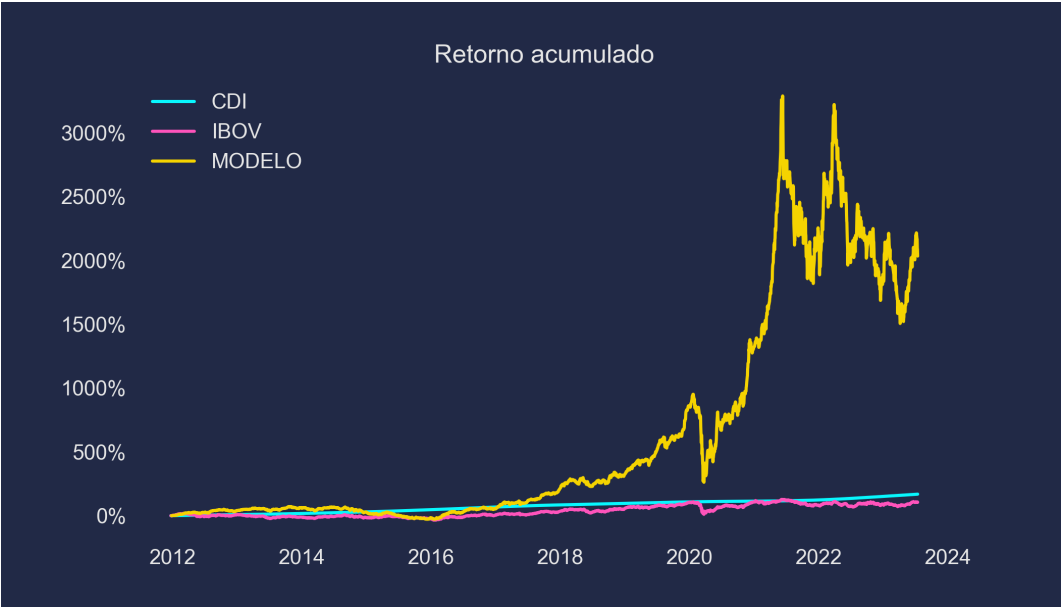


Relatório do Modelo

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

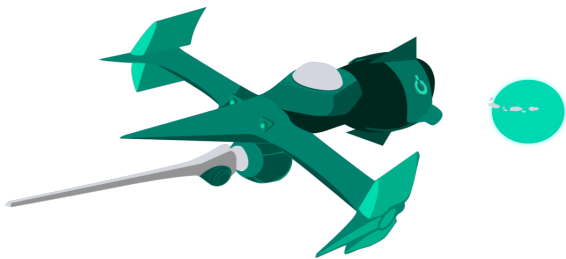


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	2033.05%
Retorno acum. CDI	168.8%
Retorno acum. IBOV	105.26%
Retorno a.a. modelo	30.95%
Vol 252d	32.89%
Índice Sharpe	0.66
VAR diário 95%	-2.81%
Turn over carteira	31.2%
Drawdown máximo	-65.58%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	137
% Operações vencedoras	59.85%
% Operações perdedoras	40.15%
Média de ganhos	9.49%
Média de perdas	-6.85%
Expec. matemática por trade	2.93%
Maior sequência de vitória	14
Maior sequência de derrotas	9
% Meses carteira > IBOV	58.7%



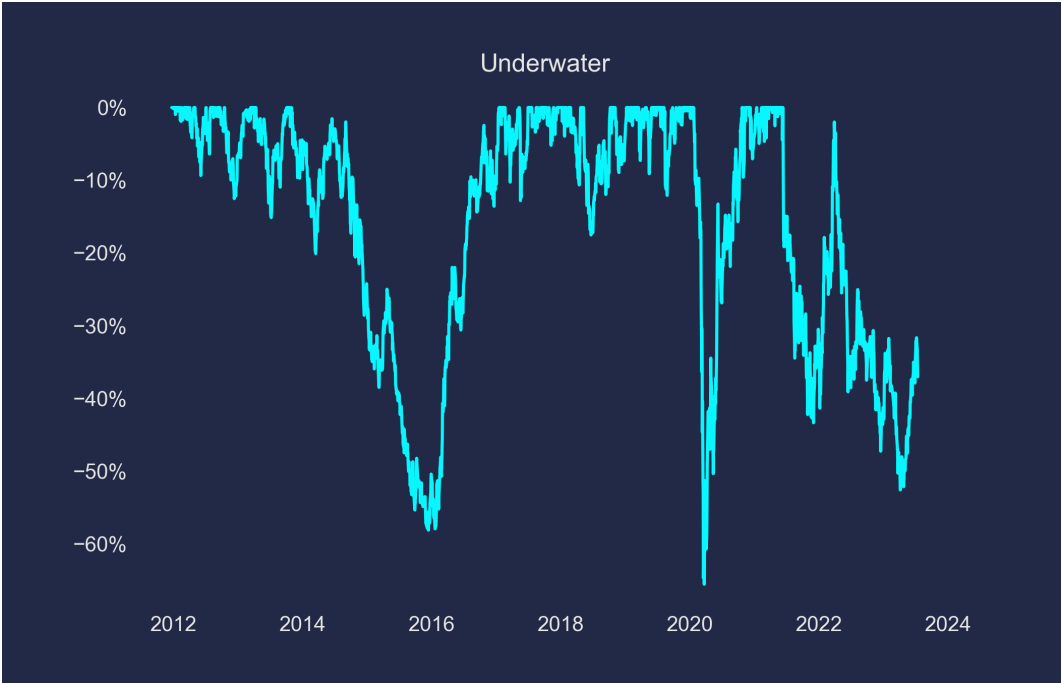
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

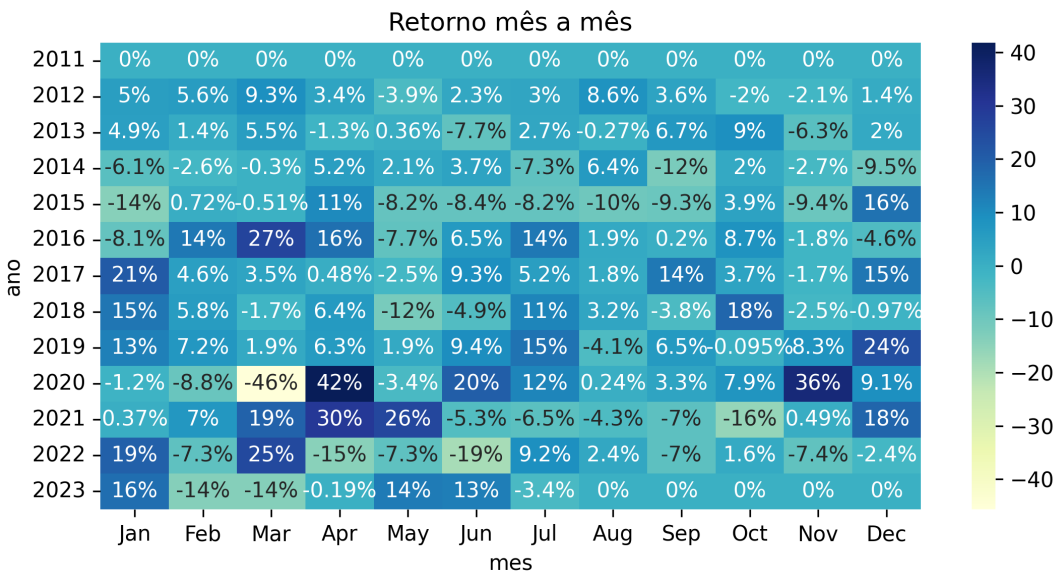
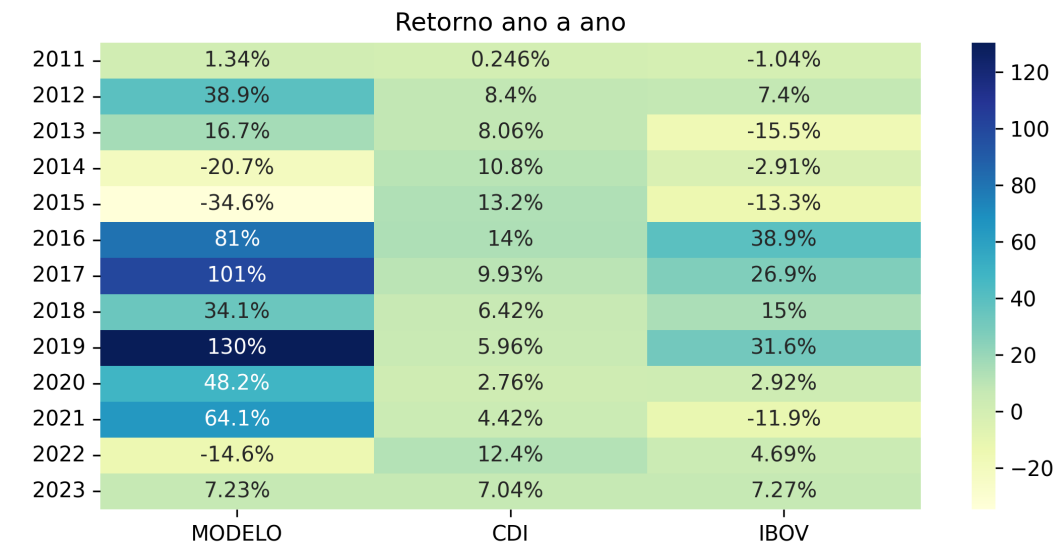
Joesley Day - 18/05/2017	-9.52%
Auge pandemia: Março - 2020	-47.05%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.75%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-4.44%
Precatórios - ago/nov 2021	-21.84%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-61.78%
Pior período de 3 meses	-60.85%
Pior período de 6 meses	-48.47%
Pior período de 1 ano	-51.84%
Pior período de 2 anos	-55.76%
Pior período de 3 anos	-49.46%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

