

Relatório do Modelo

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

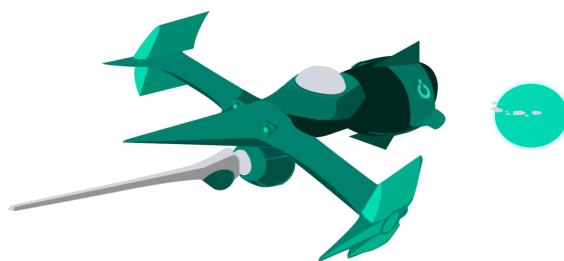


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	2087.63%
Retorno acum. CDI	123.35%
Retorno acum. IBOV	82.78%
Retorno a.a. modelo	36.89%
Vol 252d	36.03%
Índice Sharpe	1.05
VAR diário 95%	-2.2%
Turn over carteira	30.74%
Drawdown máximo	-58.04%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	118
% Operações vencedoras	66.1%
% Operações perdedoras	33.9%
Média de ganhos	7.65%
Média de perdas	-5.75%
Expec. matemática por trade	3.11%
Maior sequência de vitória	14
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	67.23%



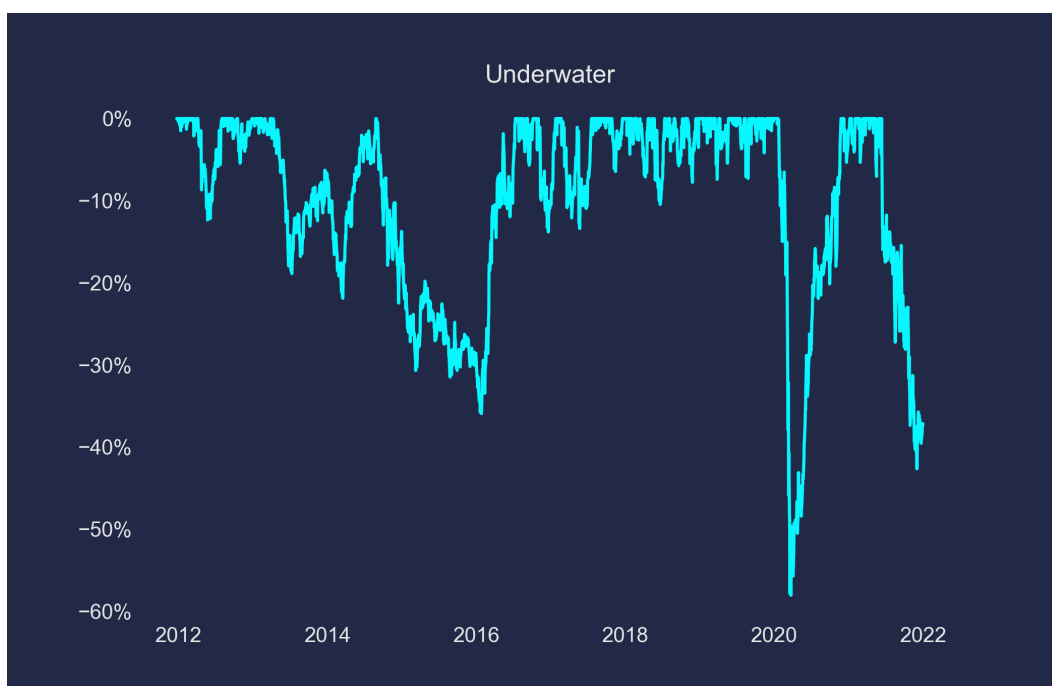
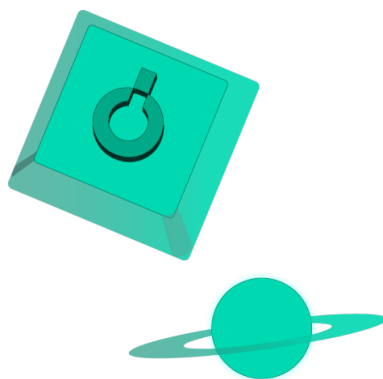
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

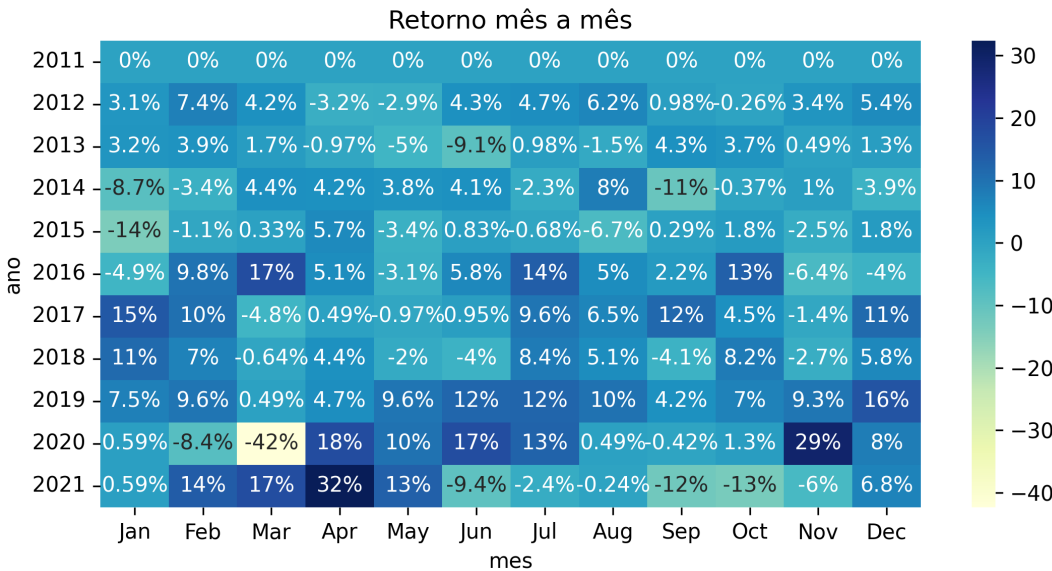
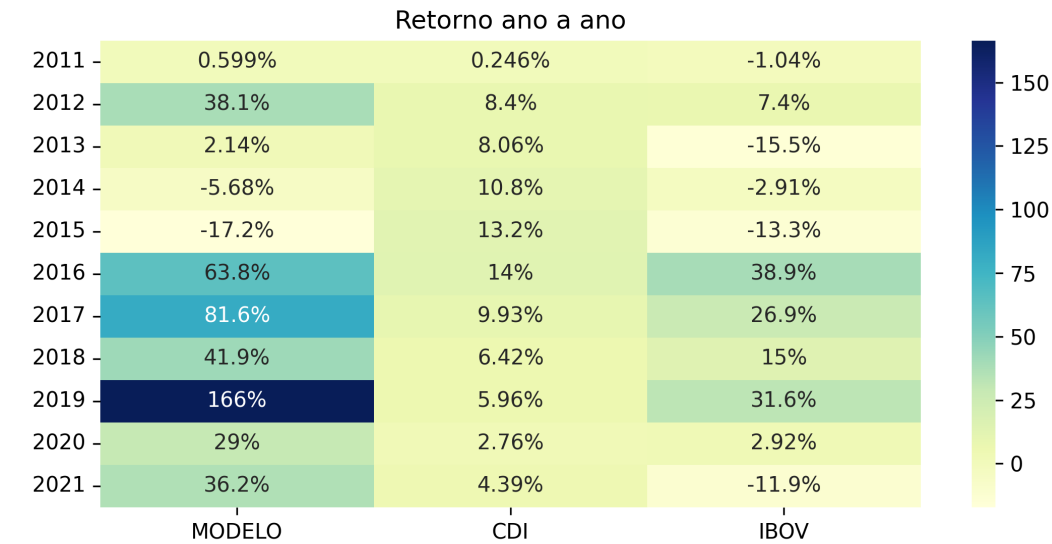
Joesley Day - 18/05/2017	-10.39%
Auge pandemia: Março - 2020	-44.38%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	4.58%
Precatórios - ago/nov 2021	-22.52%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-55.12%
Pior período de 3 meses	-52.61%
Pior período de 6 meses	-40.08%
Pior período de 1 ano	-30.42%
Pior período de 2 anos	-28.83%
Pior período de 3 anos	-28.37%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

