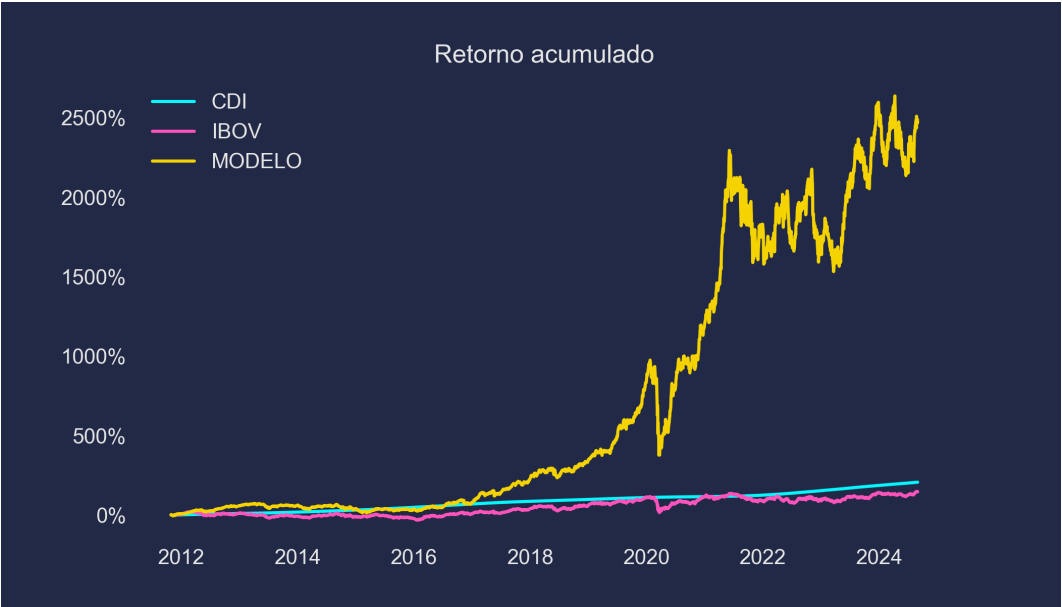


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-25
Dia final	2024-08-30
Dias totais	3185

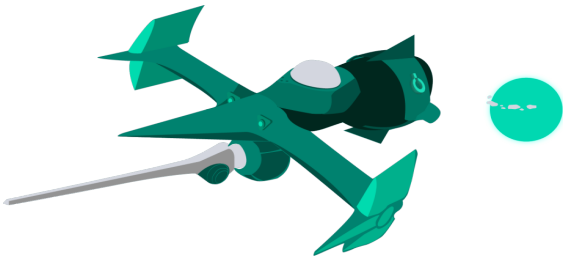


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	2474.84%
Retorno acum. CDI	206.51%
Retorno acum. IBOV	146.03%
Retorno a.a. modelo	29.31%
Vol 252d	25.07%
Índice Sharpe	0.77
VAR diário 95%	-2.31%
Turn over carteira	23.4%
Drawdown máximo	-55.63%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	145
% Operações vencedoras	67.59%
% Operações perdedoras	32.41%
Média de ganhos	6.81%
Média de perdas	-6.12%
Expec. matemática por trade	2.62%
Maior sequência de vitória	13
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	65.07%



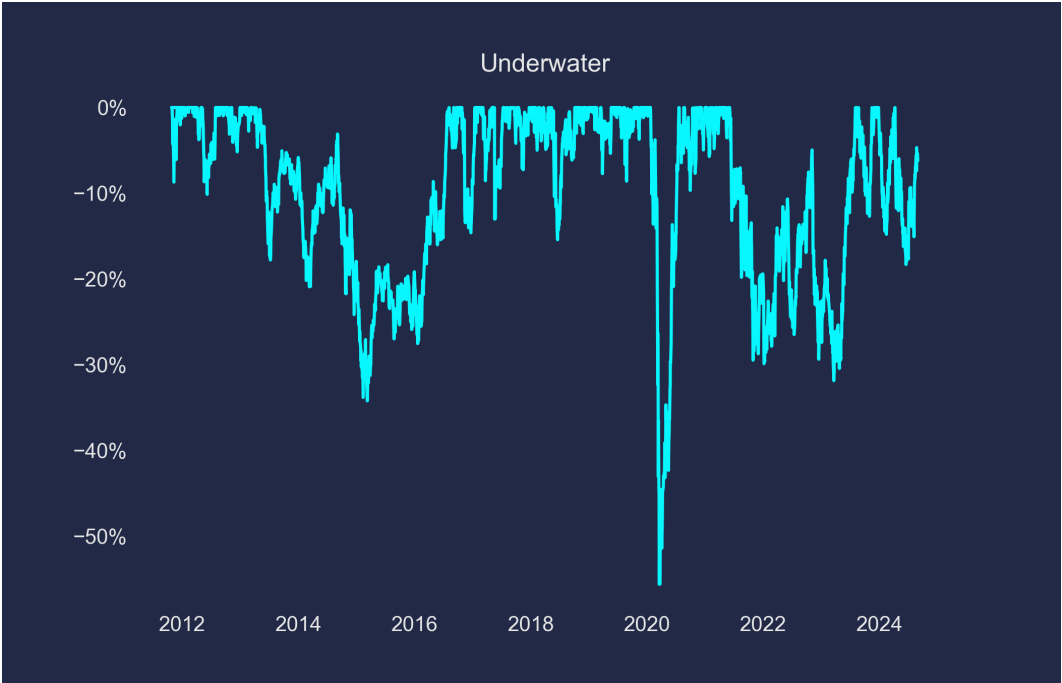
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

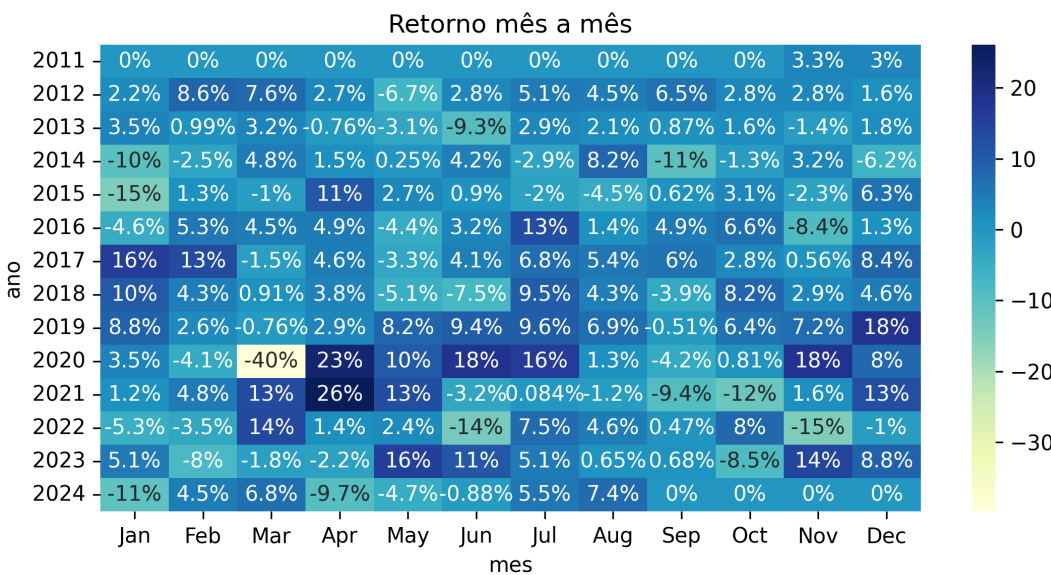
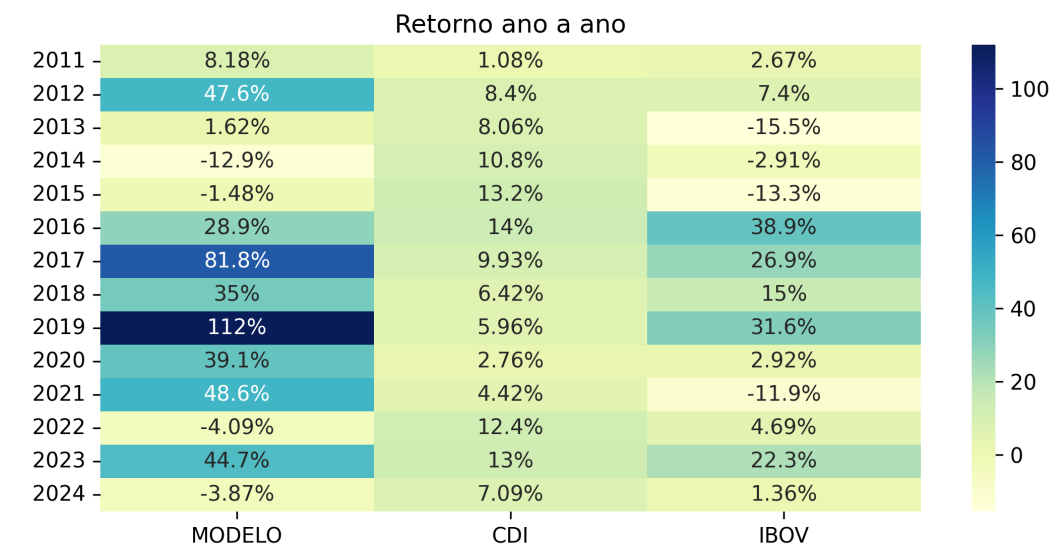
Joesley Day - 18/05/2017	-12.26%
Auge pandemia: Março - 2020	-41.95%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-6.46%
Greve dos caminhoneiros - 2018	1.16%
Precatórios - ago/nov 2021	-20.52%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-53.7%
Pior período de 3 meses	-47.21%
Pior período de 6 meses	-32.13%
Pior período de 1 ano	-22.88%
Pior período de 2 anos	-31.83%
Pior período de 3 anos	-21.71%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

