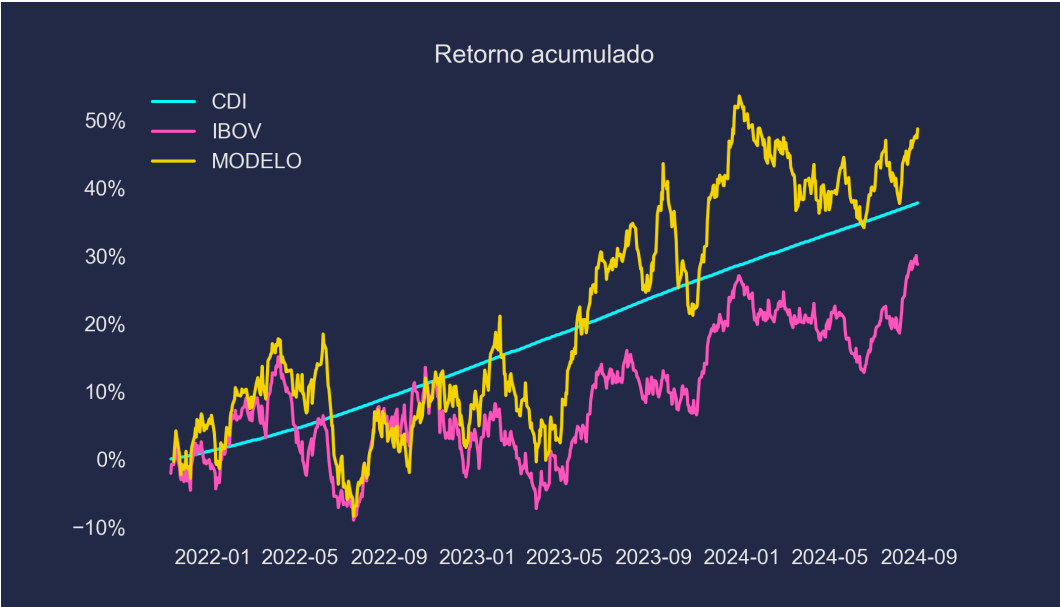


Relatório do Modelo

Dia inicial	2021-11-04
Dia final	2024-08-30
Dias totais	705

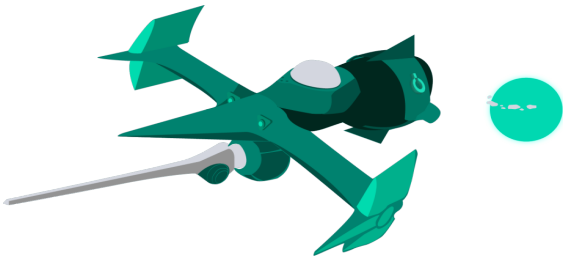


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	48.74%
Retorno acum. CDI	37.83%
Retorno acum. IBOV	28.77%
Retorno a.a. modelo	15.25%
Vol 252d	16.74%
Índice Sharpe	0.15
VAR diário 95%	-2.08%
Turn over carteira	16.54%
Drawdown máximo	-22.69%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	32
% Operações vencedoras	59.38%
% Operações perdedoras	40.62%
Média de ganhos	4.71%
Média de perdas	-3.5%
Expec. matemática por trade	1.38%
Maior sequência de vitória	5
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	57.58%



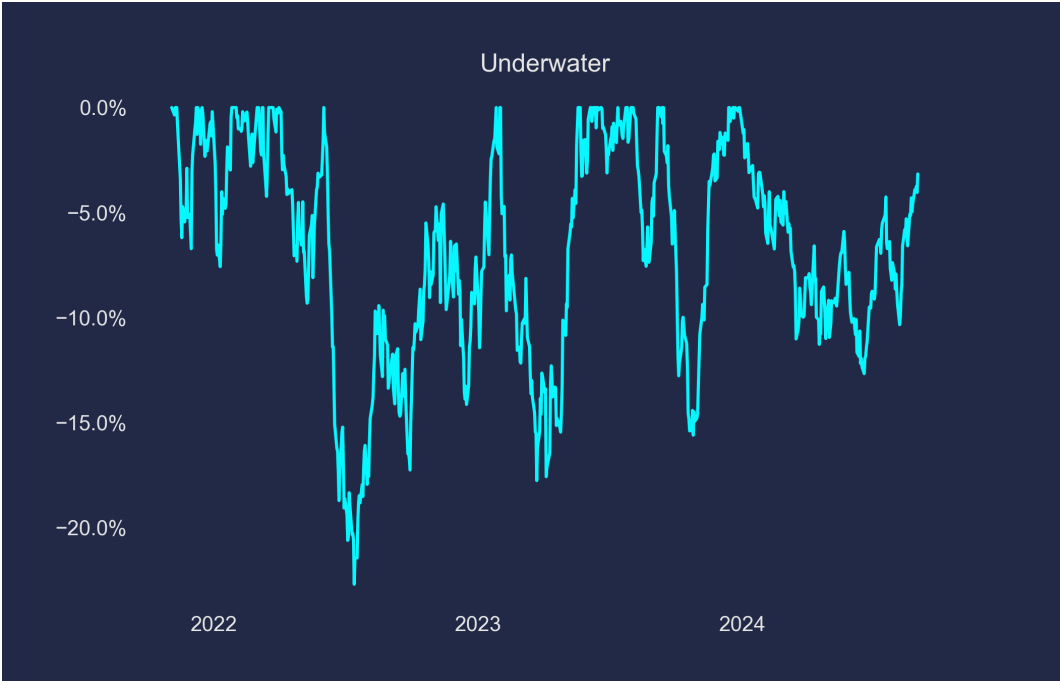
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

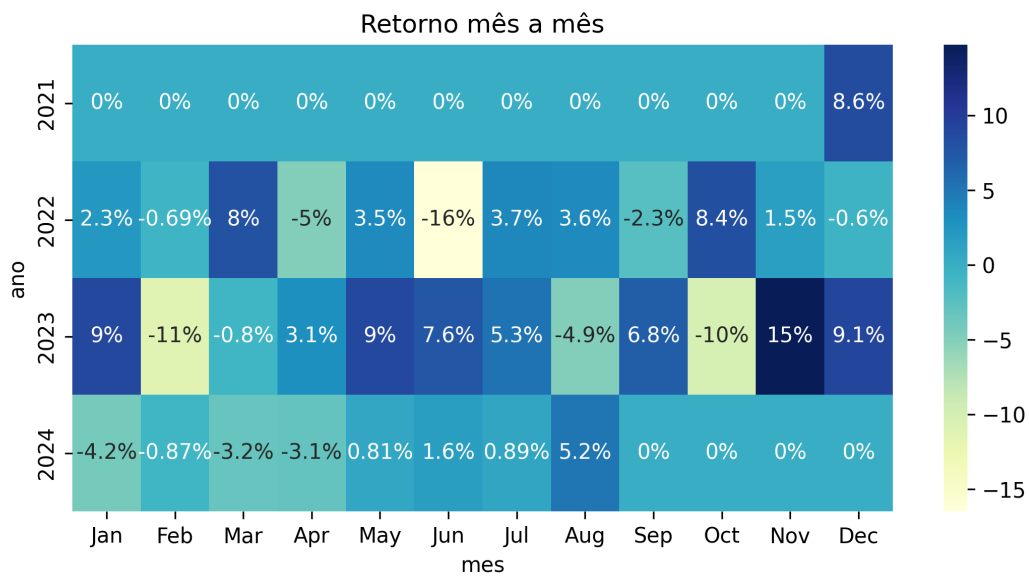
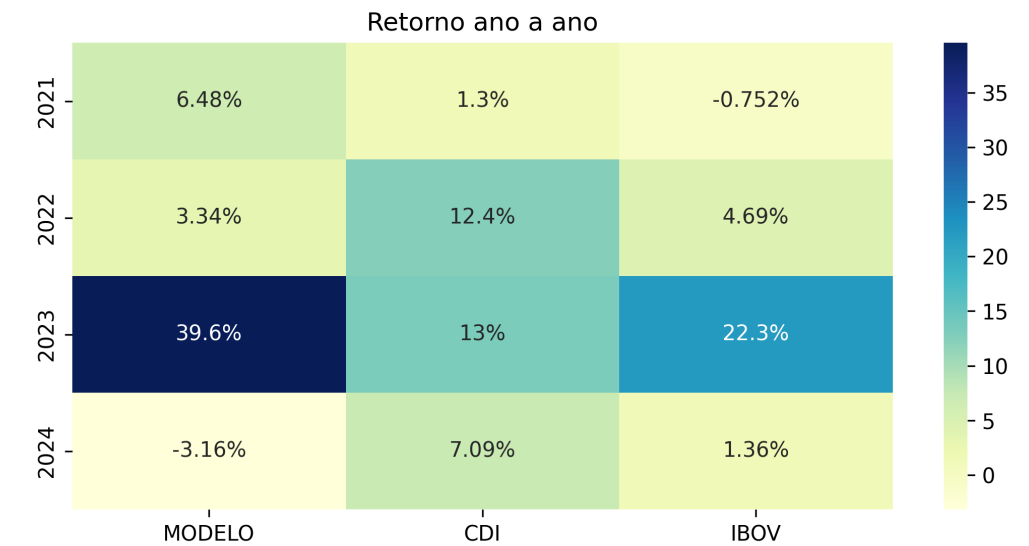
Joesley Day - 18/05/2017	-
Auge pandemia: Março - 2020	-
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.27%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-
Precatórios - ago/nov 2021	-
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-19.64%
Pior período de 3 meses	-19.97%
Pior período de 6 meses	-16.03%
Pior período de 1 ano	-15.06%
Pior período de 2 anos	15.24%
Pior período de 3 anos	nan%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

