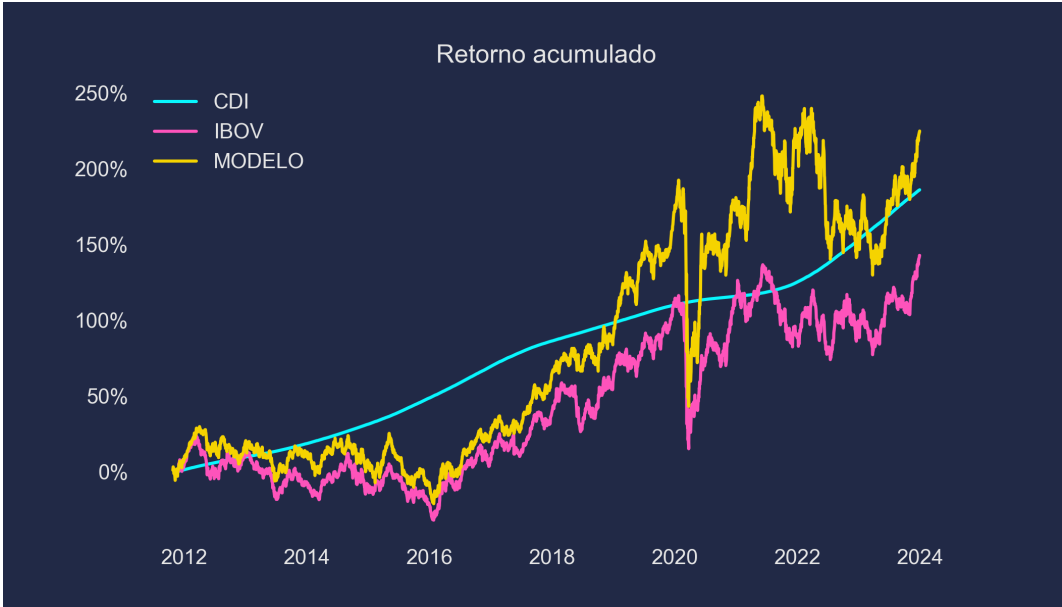


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-25
Dia final	2023-12-28
Dias totais	3016

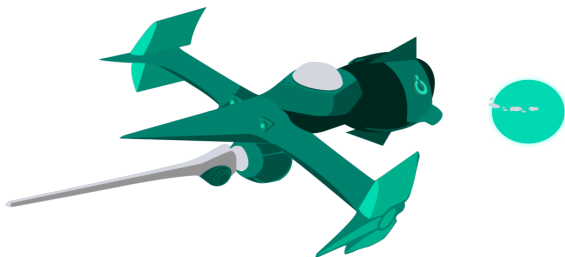


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	224.92%
Retorno acum. CDI	186.09%
Retorno acum. IBOV	142.74%
Retorno a.a. modelo	10.35%
Vol 252d	19.72%
Índice Sharpe	0.05
VAR diário 95%	-2.32%
Turn over carteira	18.28%
Drawdown máximo	-51.1%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	138
% Operações vencedoras	57.97%
% Operações perdedoras	42.03%
Média de ganhos	5.46%
Média de perdas	-4.91%
Expec. matemática por trade	1.1%
Maior sequência de vitória	6
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	52.52%



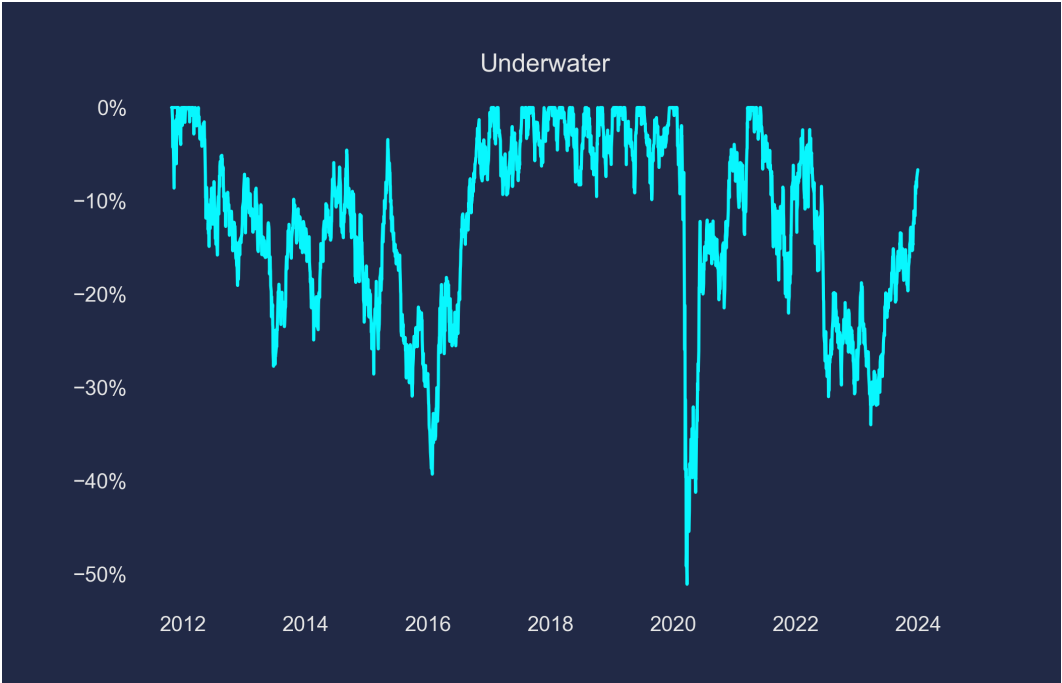
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

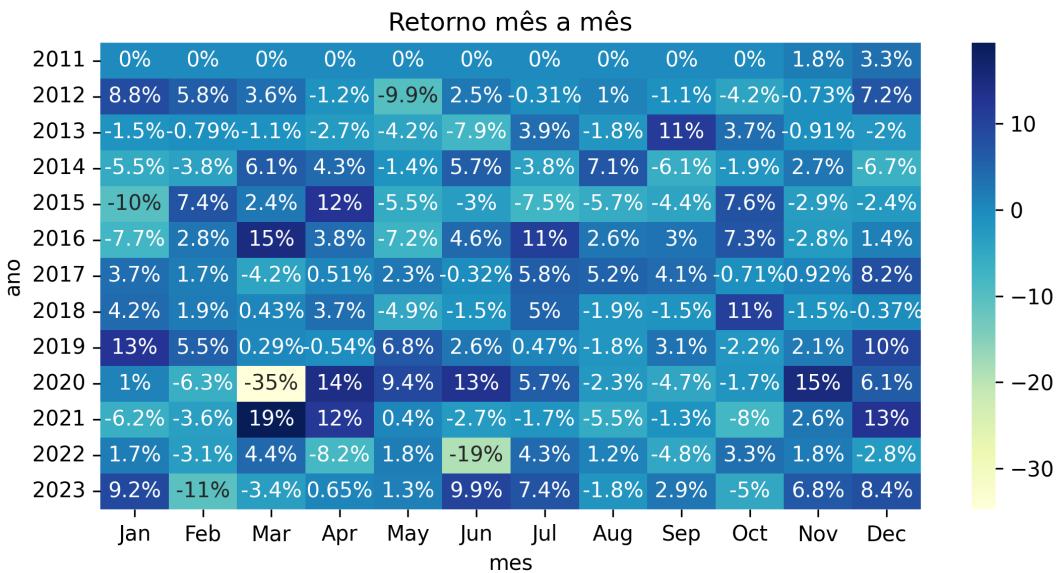
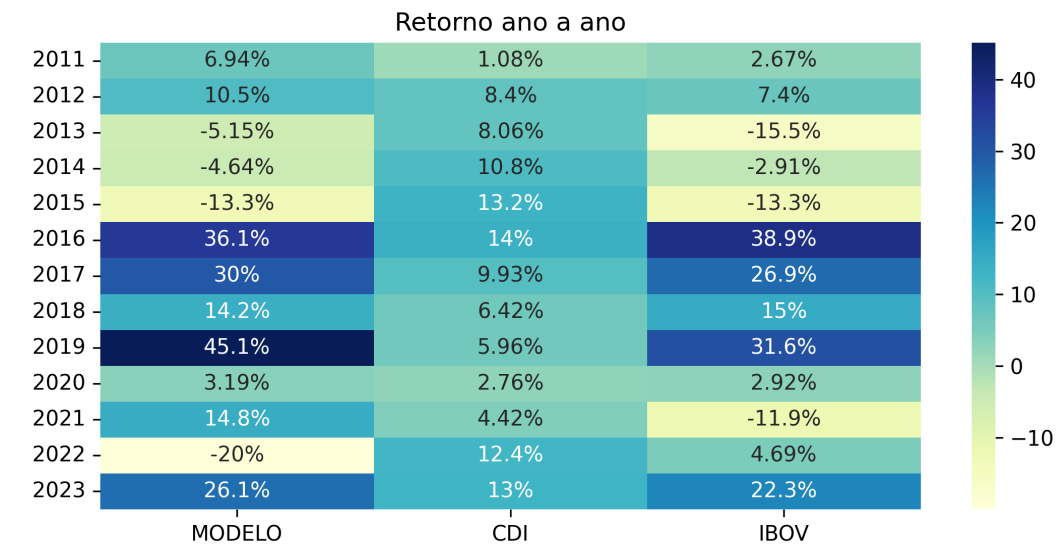
Joesley Day - 18/05/2017	-4.71%
Auge pandemia: Março - 2020	-37.02%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.37%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-0.02%
Precatórios - ago/nov 2021	-12.9%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-50.13%
Pior período de 3 meses	-44.85%
Pior período de 6 meses	-42.34%
Pior período de 1 ano	-38.05%
Pior período de 2 anos	-29.95%
Pior período de 3 anos	-34.36%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

