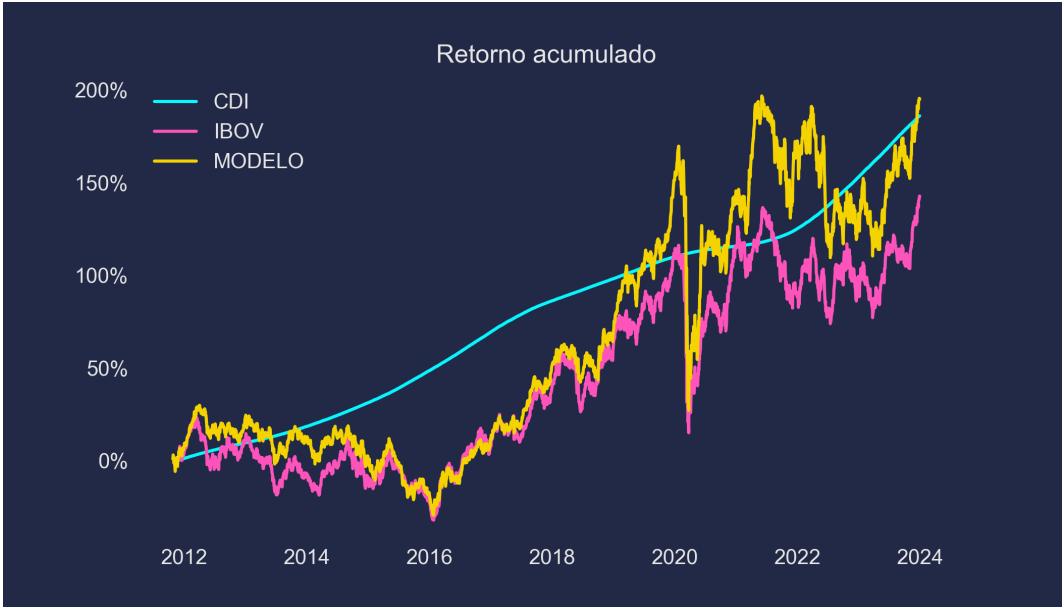


# Relatório do Modelo

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

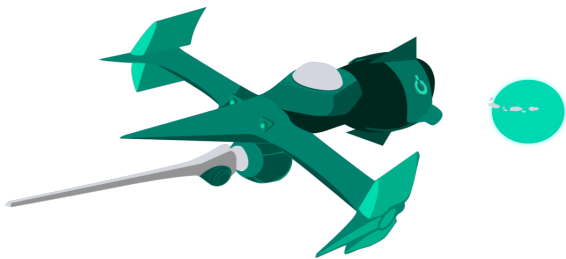


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	194.99%
Retorno acum. CDI	186.09%
Retorno acum. IBOV	142.74%
Retorno a.a. modelo	9.46%
Vol 252d	19.52%
Índice Sharpe	0.01
VAR diário 95%	-2.15%
Turn over carteira	15.3%
Drawdown máximo	-52.9%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	138
% Operações vencedoras	57.25%
% Operações perdedoras	42.75%
Média de ganhos	5.3%
Média de perdas	-4.72%
Expec. matemática por trade	1.02%
Maior sequência de vitória	5
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	50.36%



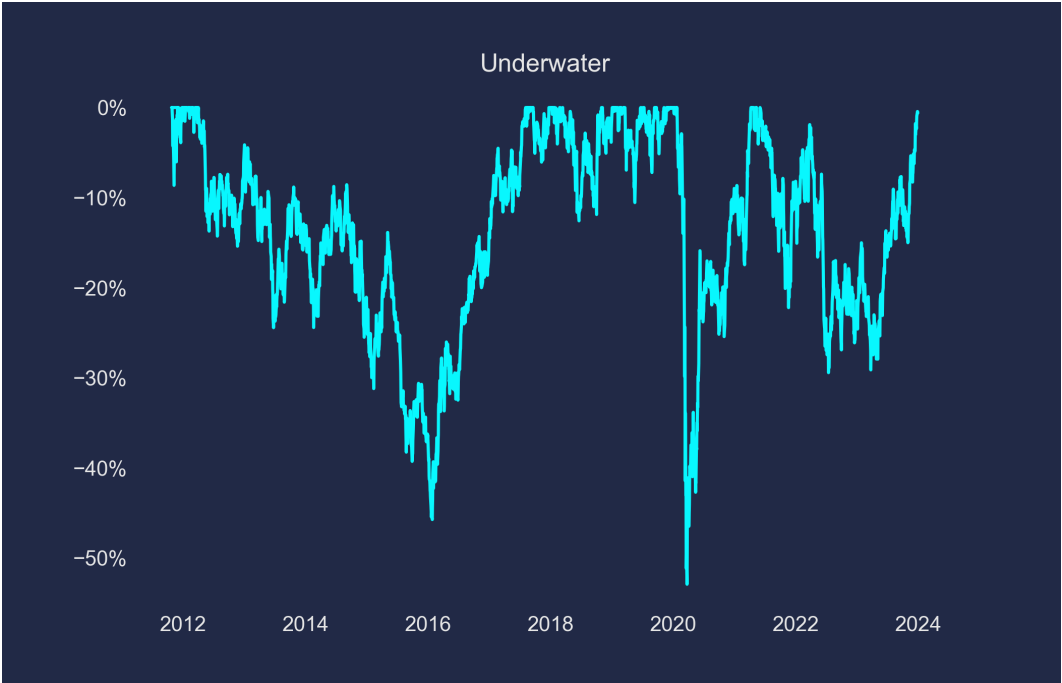
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

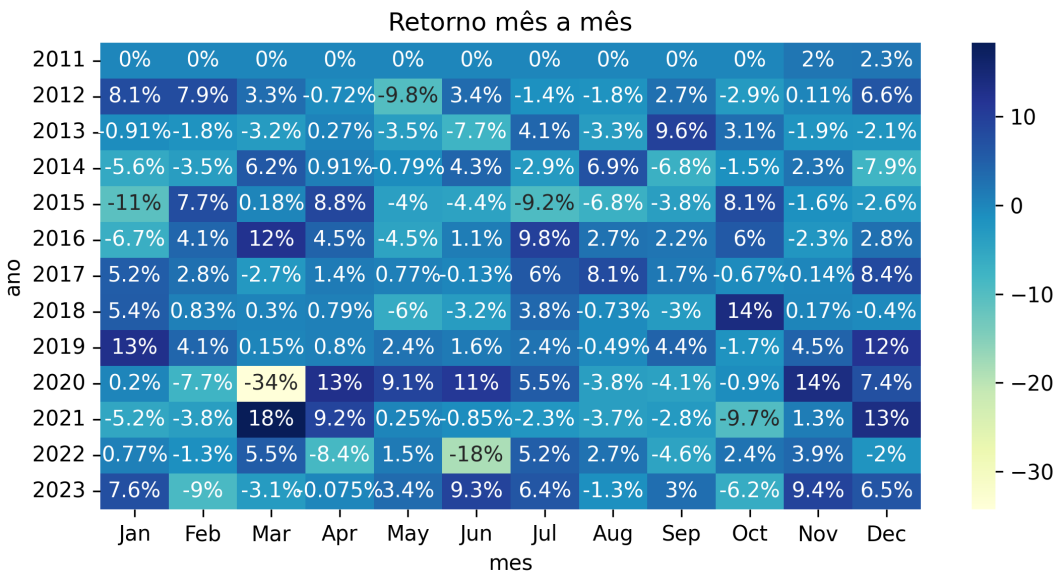
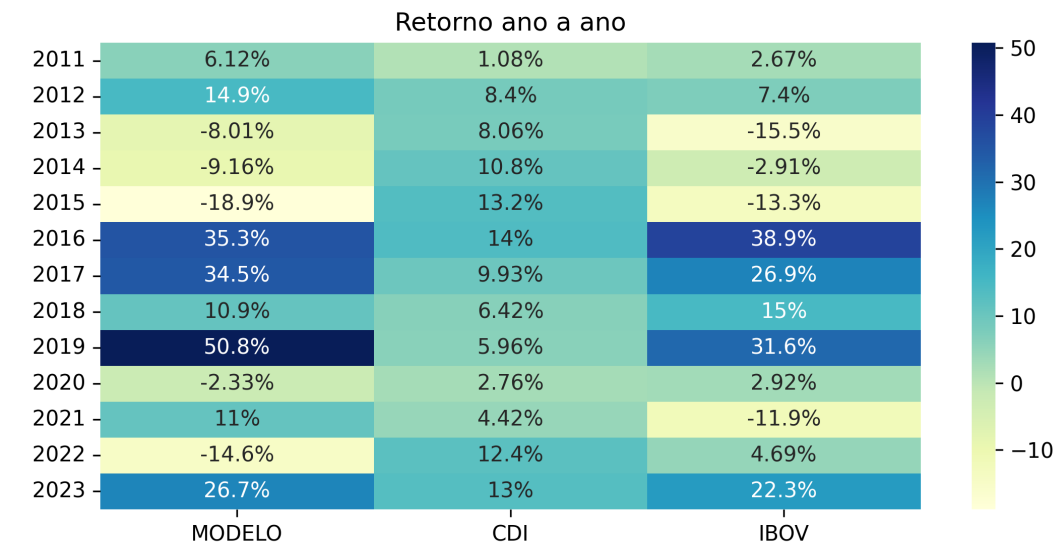
Joesley Day - 18/05/2017	-5.41%
Auge pandemia: Março - 2020	-36.35%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-2.75%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-3.85%
Precatórios - ago/nov 2021	-14.66%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-51.49%
Pior período de 3 meses	-47.45%
Pior período de 6 meses	-41.42%
Pior período de 1 ano	-38.04%
Pior período de 2 anos	-36.55%
Pior período de 3 anos	-43.3%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

