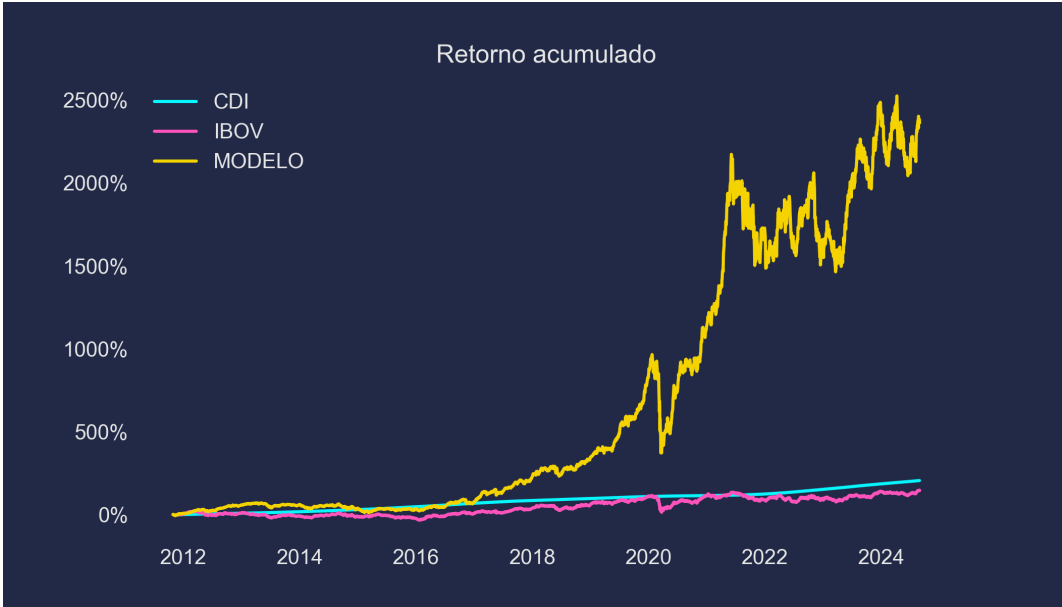


Relatório do Modelo

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

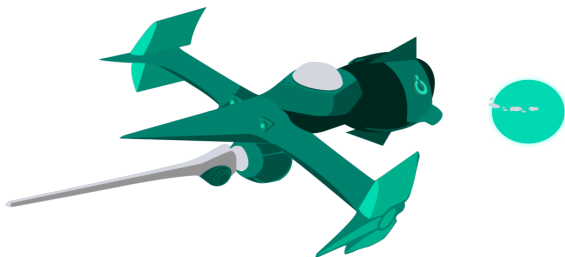


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	2368.97%
Retorno acum. CDI	206.39%
Retorno acum. IBOV	146.03%
Retorno a.a. modelo	28.88%
Vol 252d	25.08%
Índice Sharpe	0.75
VAR diário 95%	-2.31%
Turn over carteira	23.42%
Drawdown máximo	-55.61%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	145
% Operações vencedoras	67.59%
% Operações perdedoras	32.41%
Média de ganhos	6.76%
Média de perdas	-6.11%
Expec. matemática por trade	2.59%
Maior sequência de vitória	13
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	65.07%



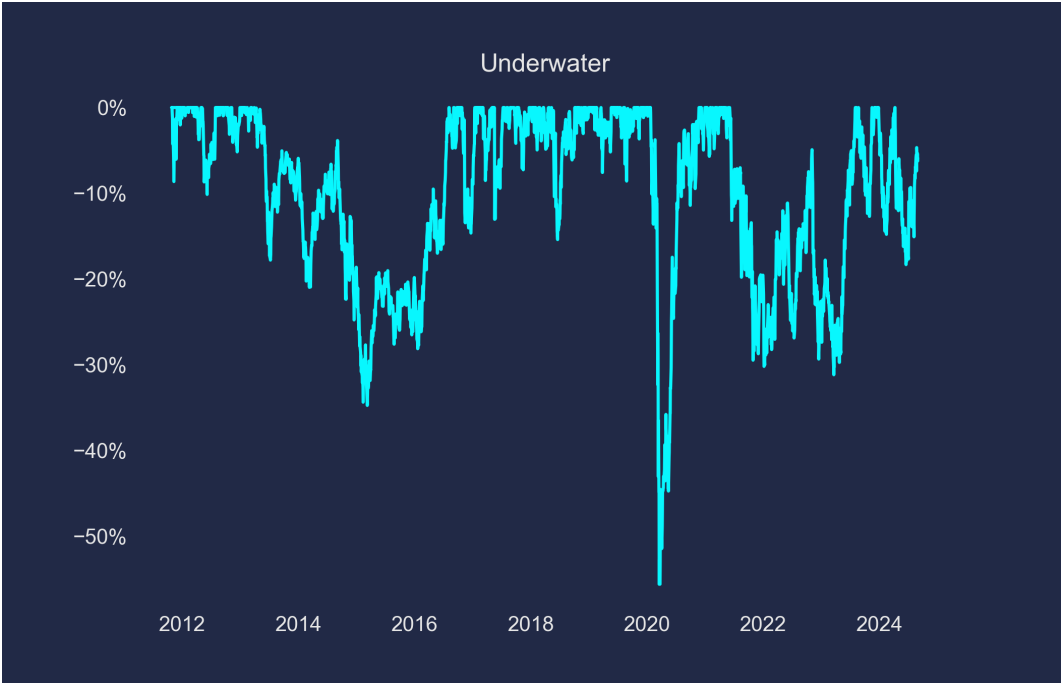
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

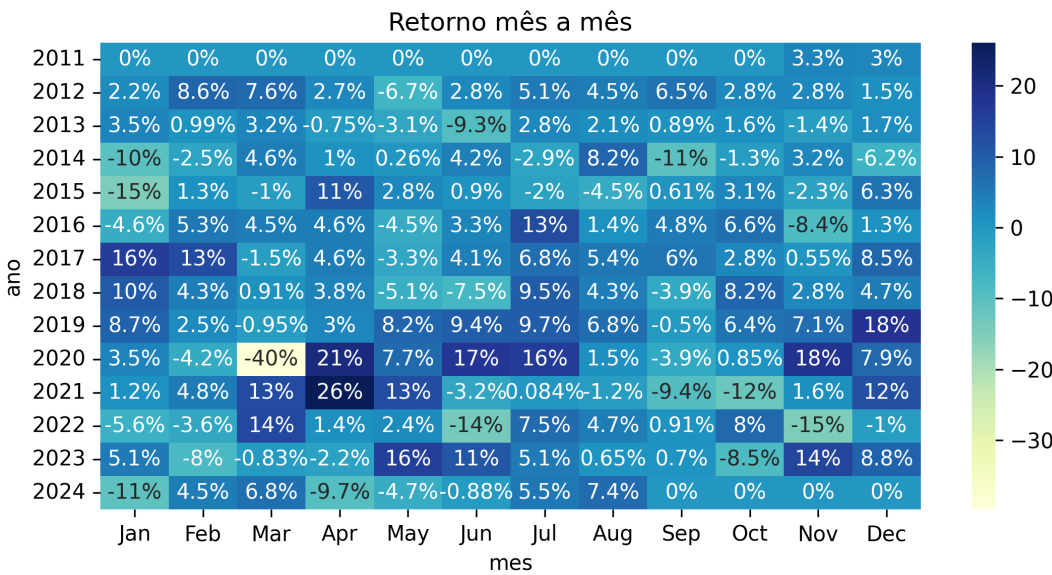
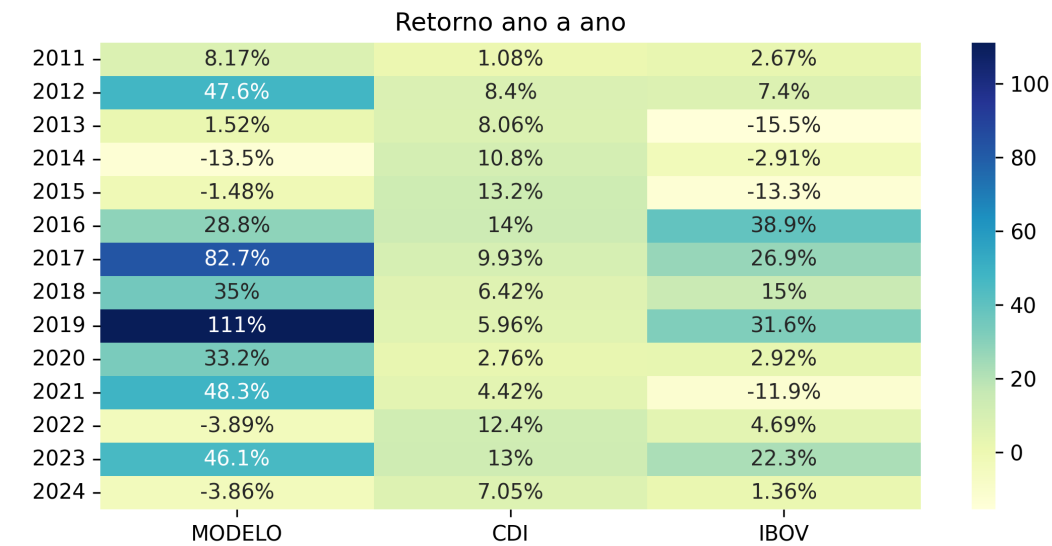
Joesley Day - 18/05/2017	-12.28%
Auge pandemia: Março - 2020	-41.94%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-6.46%
Greve dos caminhoneiros - 2018	1.17%
Precatórios - ago/nov 2021	-20.53%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-53.7%
Pior período de 3 meses	-47.22%
Pior período de 6 meses	-32.14%
Pior período de 1 ano	-22.96%
Pior período de 2 anos	-32.38%
Pior período de 3 anos	-22.35%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

