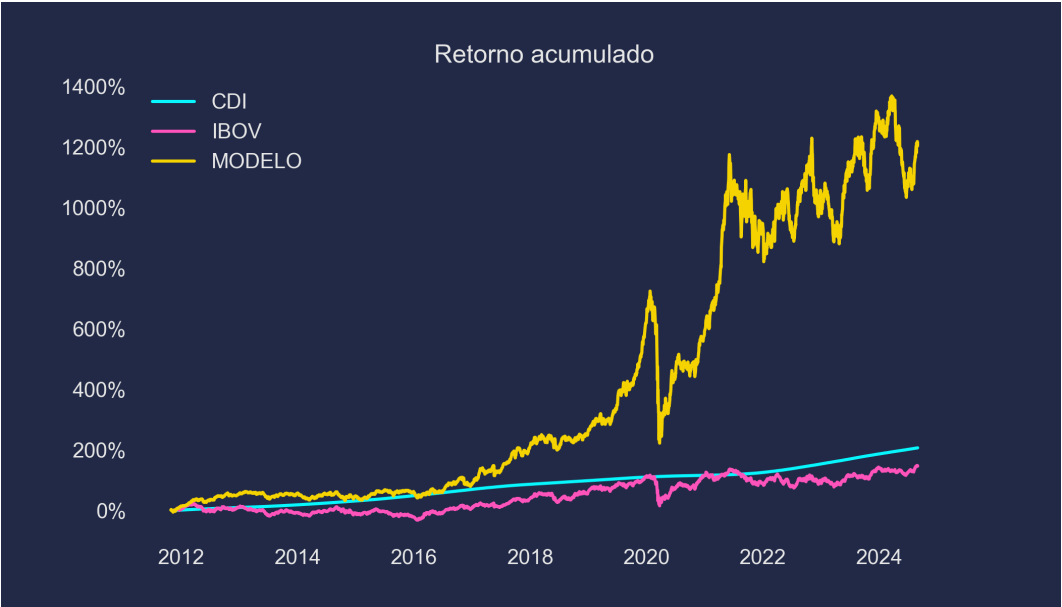


# Relatório do Modelo

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

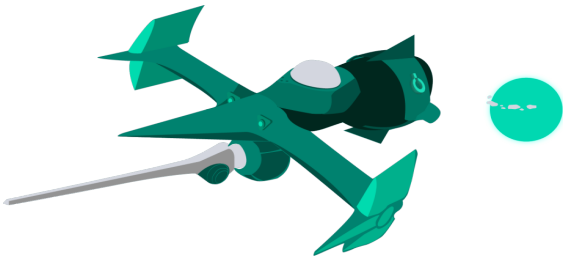


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	1209.92%
Retorno acum. CDI	206.51%
Retorno acum. IBOV	146.03%
Retorno a.a. modelo	22.57%
Vol 252d	20.57%
Índice Sharpe	0.53
VAR diário 95%	-2.21%
Turn over carteira	28.53%
Drawdown máximo	-60.93%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	145
% Operações vencedoras	65.52%
% Operações perdedoras	34.48%
Média de ganhos	6.22%
Média de perdas	-5.73%
Expec. matemática por trade	2.1%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	3
% Meses carteira > IBOV	61.64%



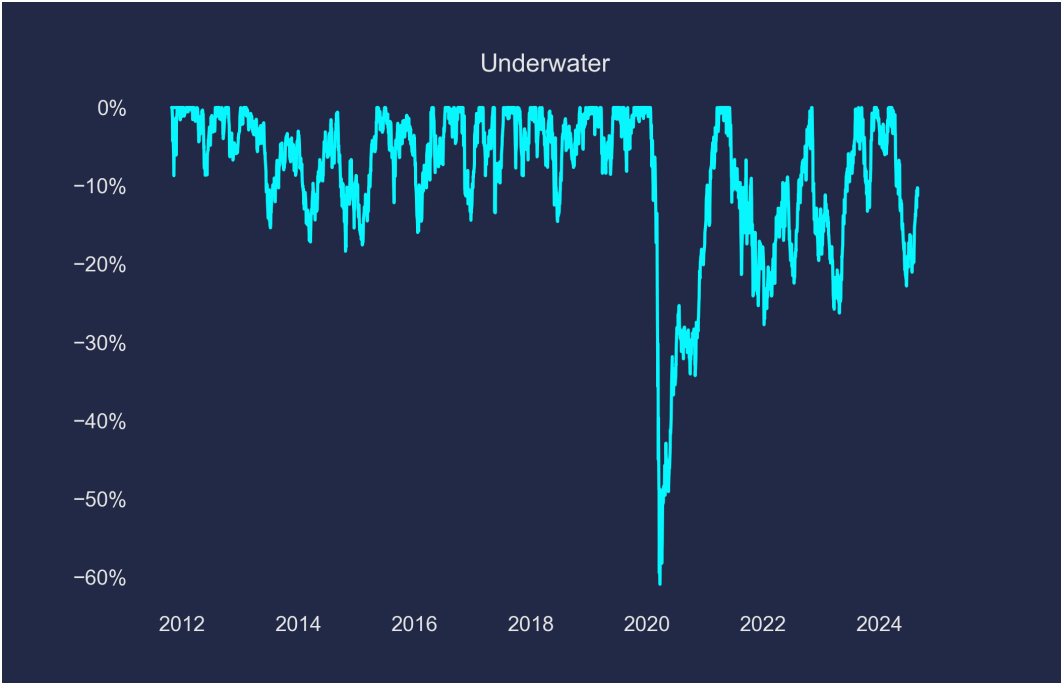
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

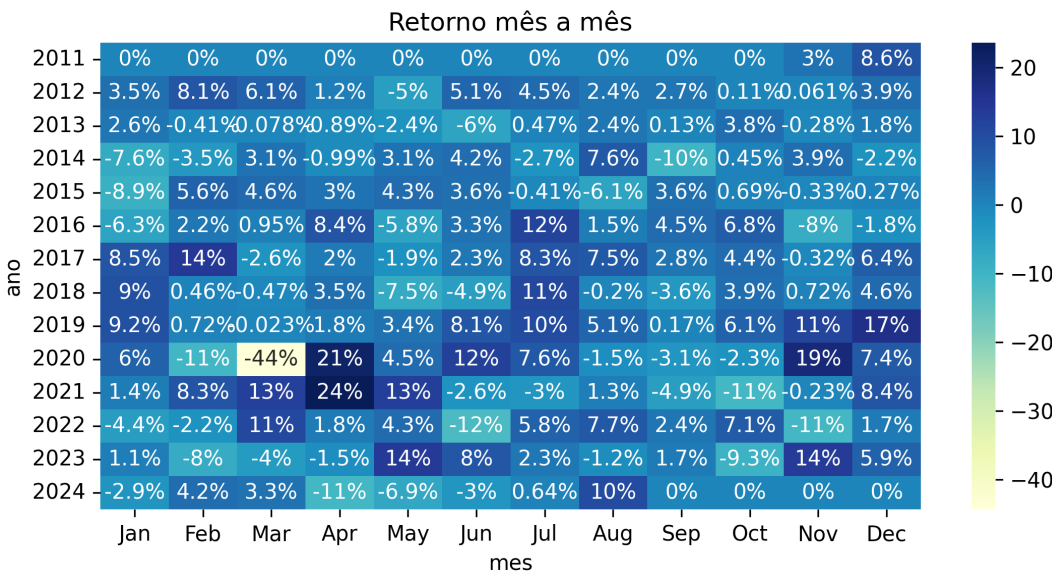
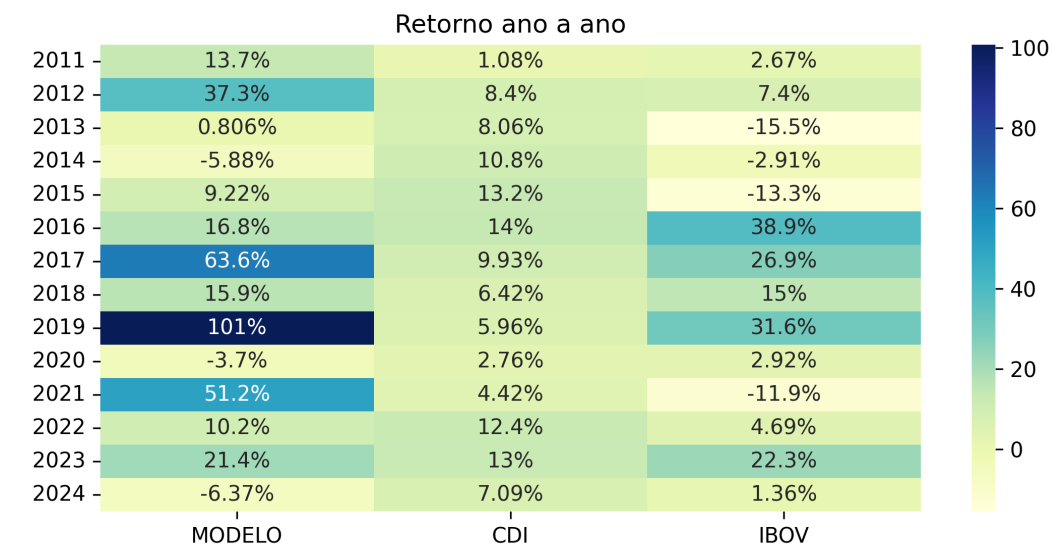
Joesley Day - 18/05/2017	-12.5%
Auge pandemia: Março - 2020	-46.2%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-5.2%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-1.5%
Precatórios - ago/nov 2021	-13.38%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-58.29%
Pior período de 3 meses	-55.07%
Pior período de 6 meses	-36.65%
Pior período de 1 ano	-23.18%
Pior período de 2 anos	-15.74%
Pior período de 3 anos	-10.49%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

