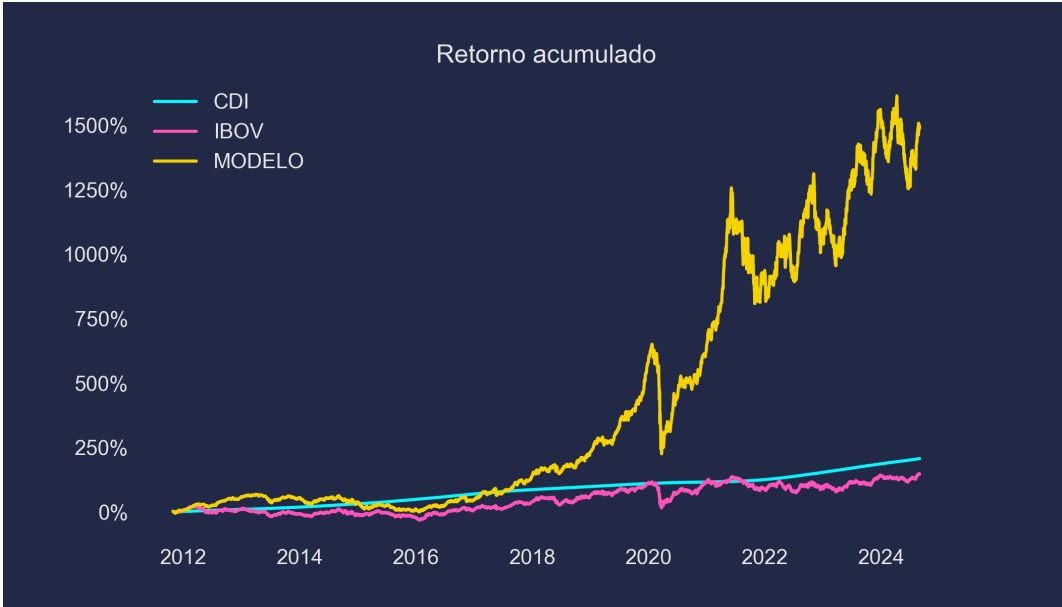


# Relatório do Modelo

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

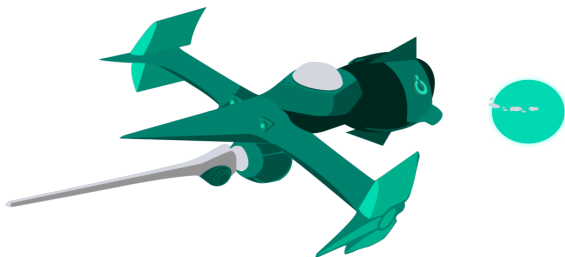


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	1490.17%
Retorno acum. CDI	206.51%
Retorno acum. IBOV	146.03%
Retorno a.a. modelo	24.47%
Vol 252d	23.46%
Índice Sharpe	0.62
VAR diário 95%	-2.19%
Turn over carteira	28.64%
Drawdown máximo	-56.68%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	145
% Operações vencedoras	67.59%
% Operações perdedoras	32.41%
Média de ganhos	6.45%
Média de perdas	-6.5%
Expec. matemática por trade	2.25%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	61.64%



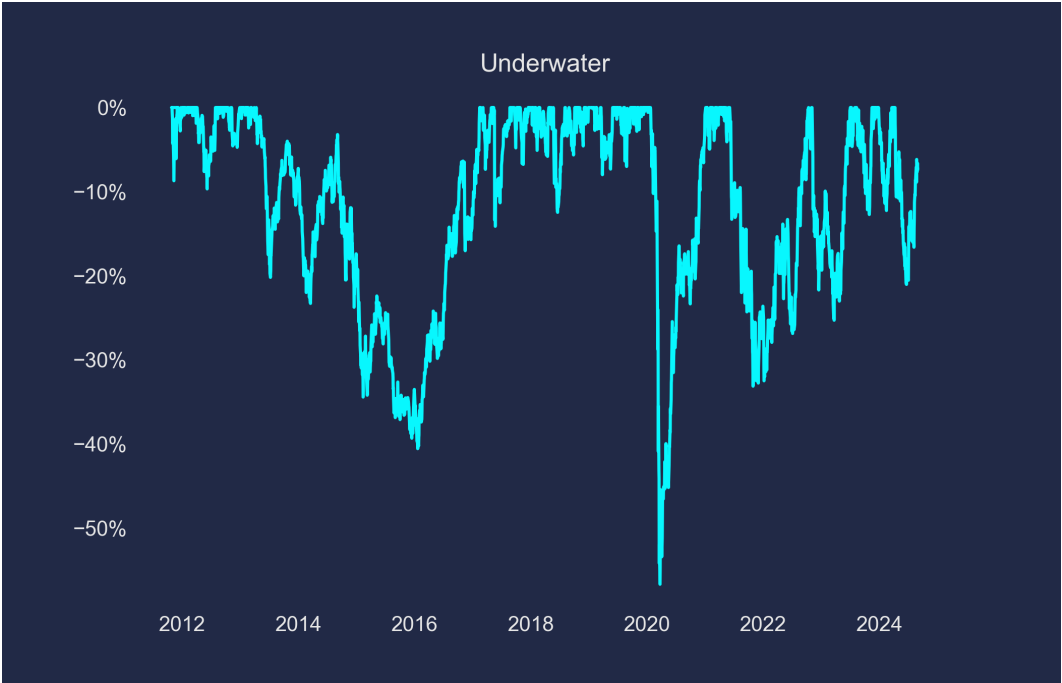
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

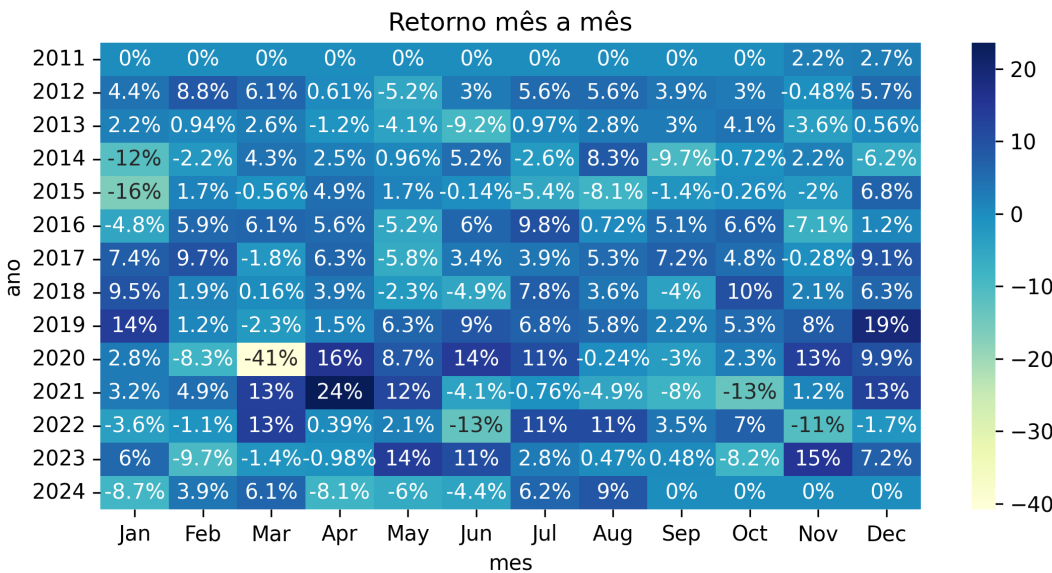
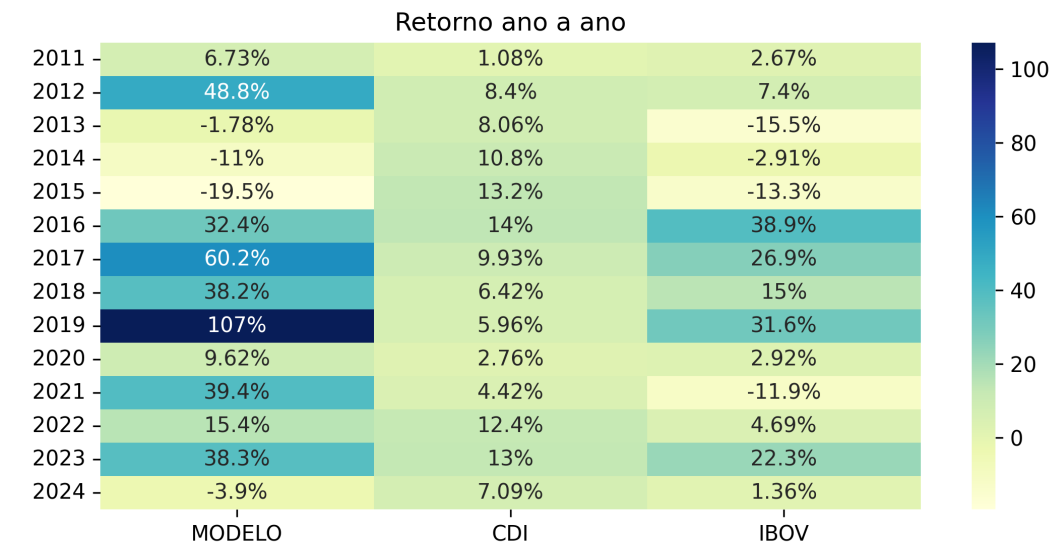
Joesley Day - 18/05/2017	-11.89%
Auge pandemia: Março - 2020	-42.58%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-6.64%
Greve dos caminhoneiros - 2018	3.56%
Precatórios - ago/nov 2021	-23.45%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-54.52%
Pior período de 3 meses	-50.45%
Pior período de 6 meses	-32.82%
Pior período de 1 ano	-33.91%
Pior período de 2 anos	-34.91%
Pior período de 3 anos	-36.98%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

