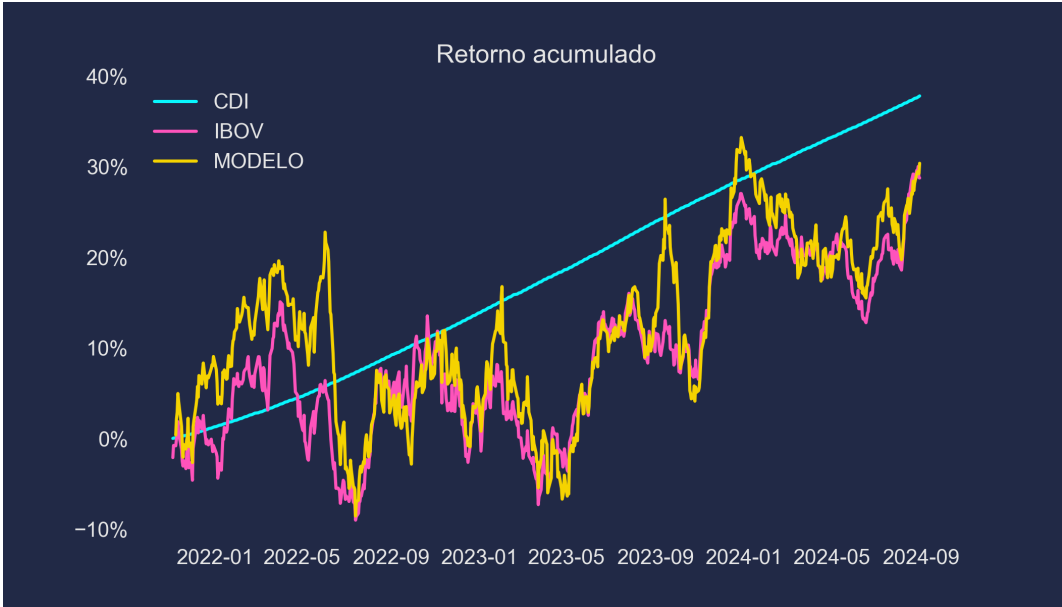


Relatório do Modelo

Dia inicial	2021-11-04
Dia final	2024-08-30
Dias totais	705

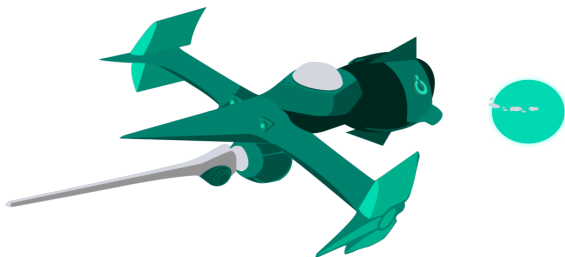


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	30.39%
Retorno acum. CDI	37.83%
Retorno acum. IBOV	28.77%
Retorno a.a. modelo	9.95%
Vol 252d	17.74%
Índice Sharpe	-0.1
VAR diário 95%	-2.19%
Turn over carteira	16.31%
Drawdown máximo	-25.51%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	32
% Operações vencedoras	53.12%
% Operações perdedoras	46.88%
Média de ganhos	4.7%
Média de perdas	-3.27%
Expec. matemática por trade	0.96%
Maior sequência de vitória	4
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	54.55%



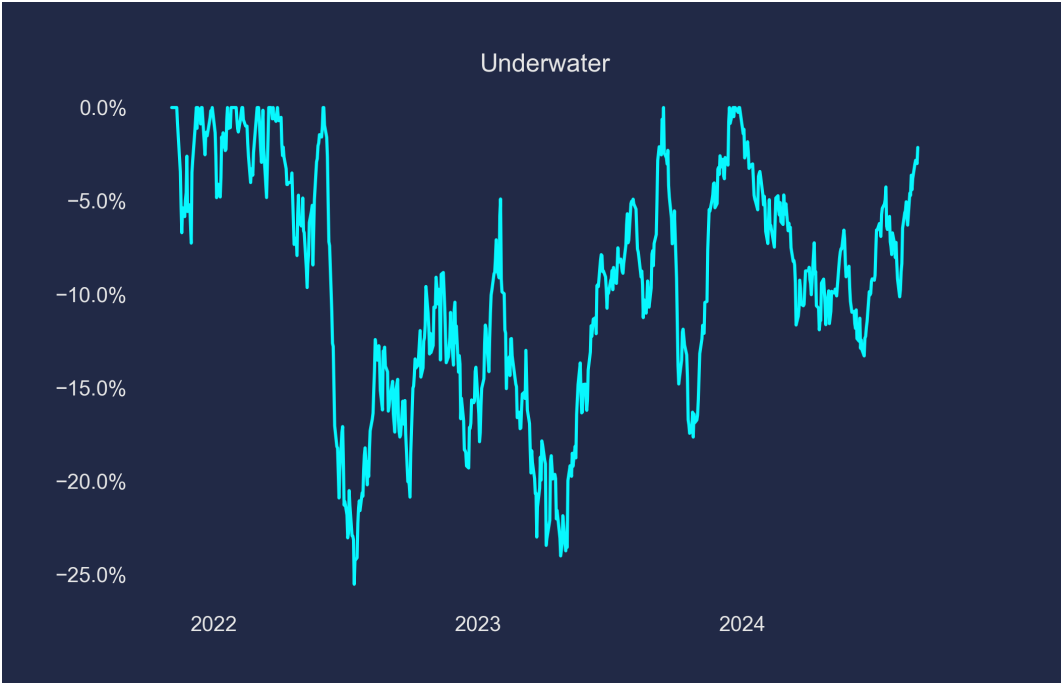
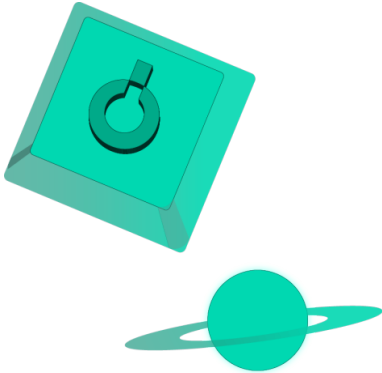
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

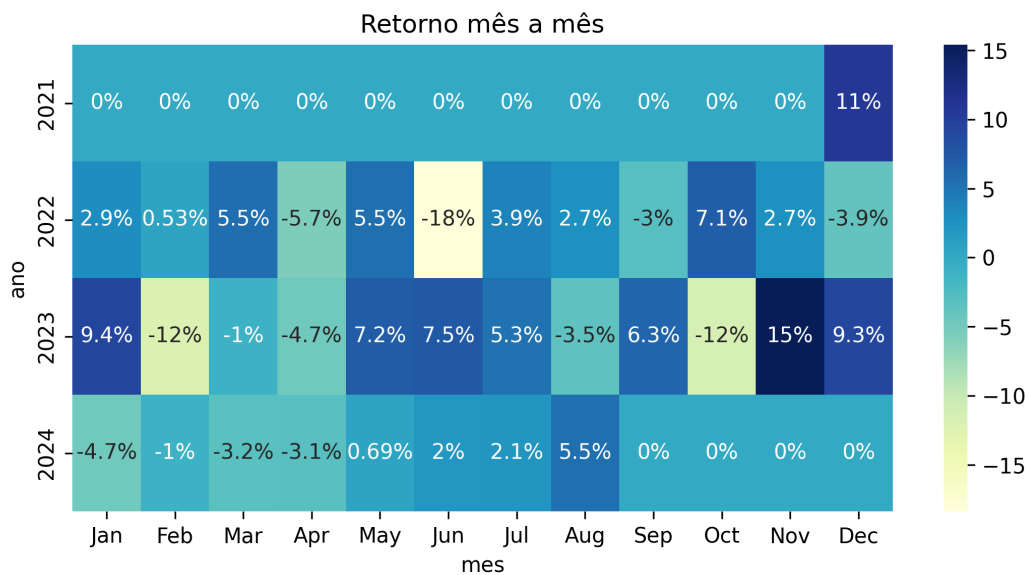
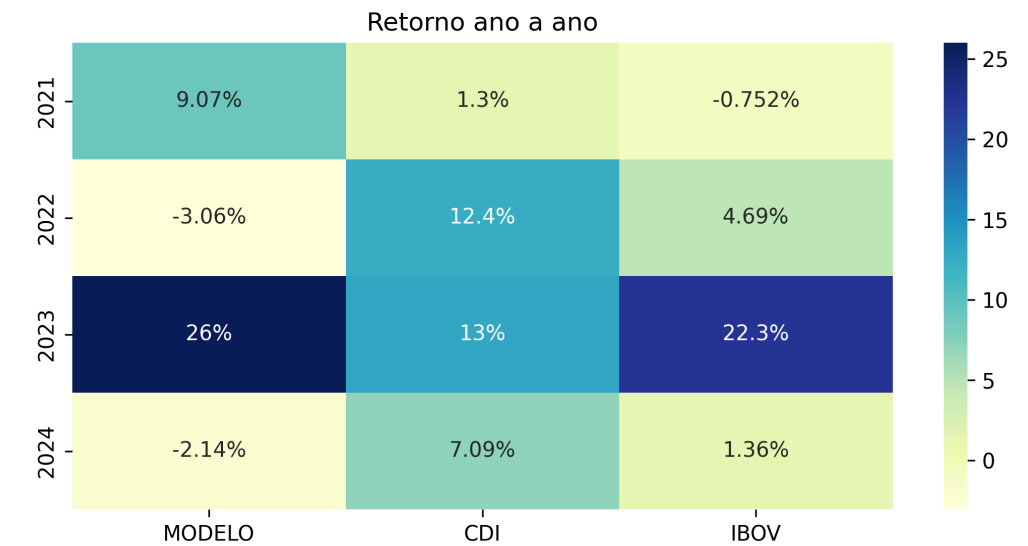
Joesley Day - 18/05/2017	-
Auge pandemia: Março - 2020	-
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.31%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-
Precatórios - ago/nov 2021	-
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-22.3%
Pior período de 3 meses	-20.58%
Pior período de 6 meses	-18.37%
Pior período de 1 ano	-20.99%
Pior período de 2 anos	-4.58%
Pior período de 3 anos	nan%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

