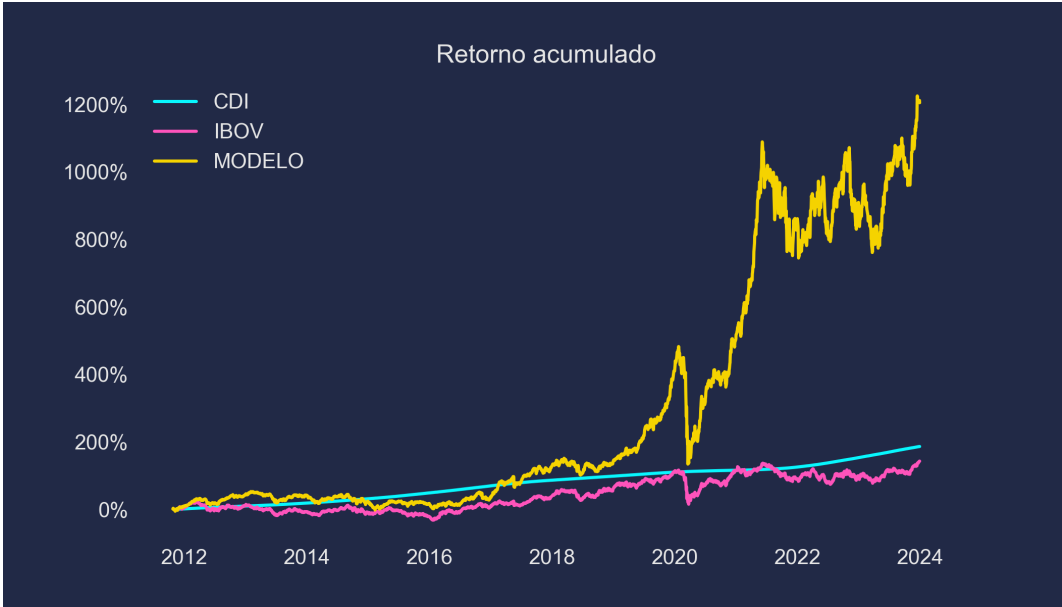


Relatório do Modelo

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

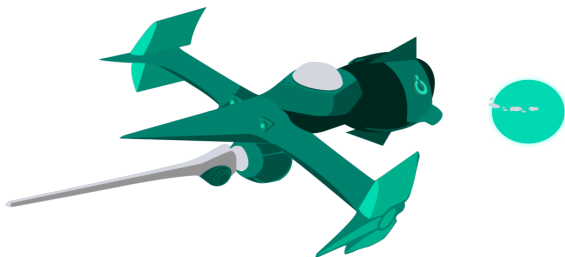


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	1204.93%
Retorno acum. CDI	186.09%
Retorno acum. IBOV	142.74%
Retorno a.a. modelo	23.94%
Vol 252d	24.23%
Índice Sharpe	0.56
VAR diário 95%	-2.34%
Turn over carteira	23.96%
Drawdown máximo	-59.82%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	138
% Operações vencedoras	63.77%
% Operações perdedoras	36.23%
Média de ganhos	7.02%
Média de perdas	-6.15%
Expec. matemática por trade	2.25%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	4
% Meses carteira > IBOV	62.59%



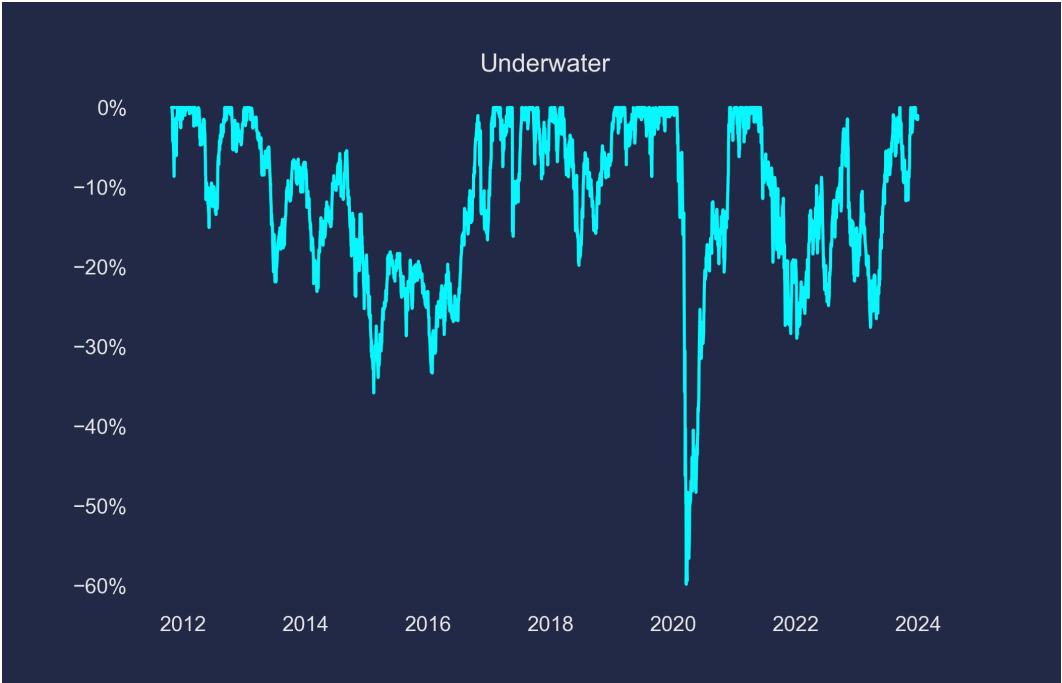
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

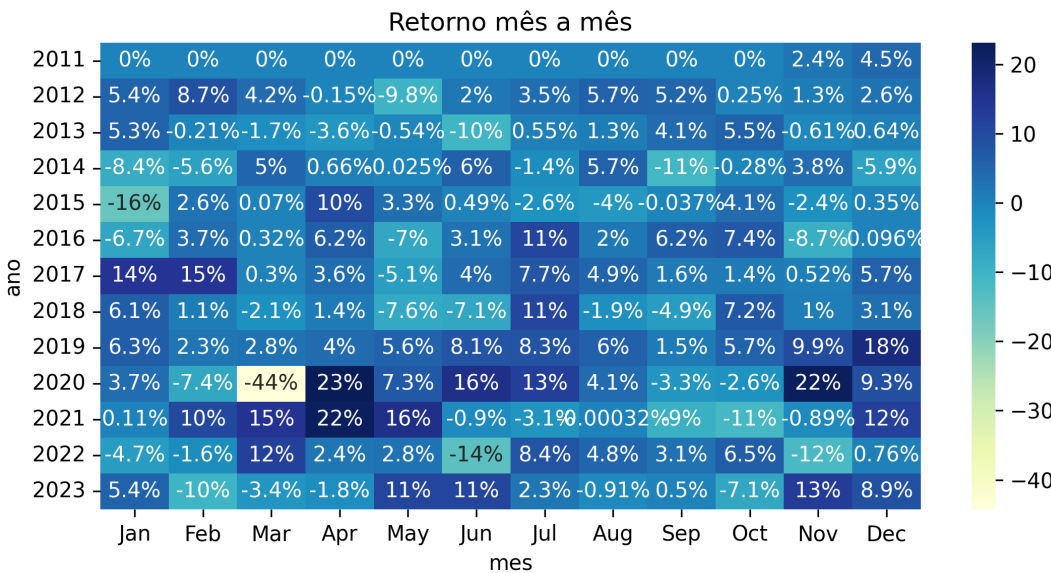
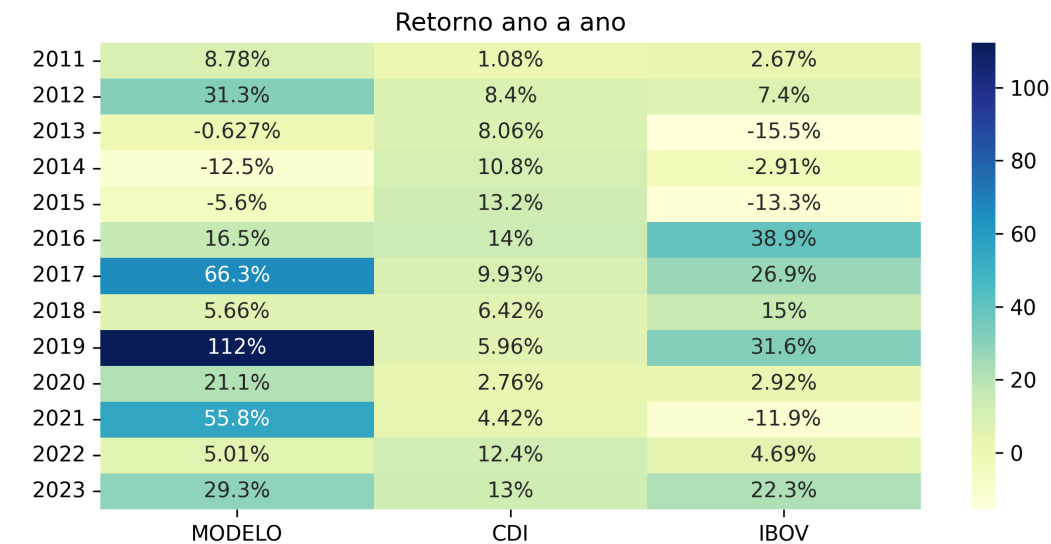
Joesley Day - 18/05/2017	-14.47%
Auge pandemia: Março - 2020	-45.77%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-5.93%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-3.22%
Precatórios - ago/nov 2021	-18.1%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-56.95%
Pior período de 3 meses	-53.14%
Pior período de 6 meses	-35.98%
Pior período de 1 ano	-21.88%
Pior período de 2 anos	-34.92%
Pior período de 3 anos	-30.3%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

