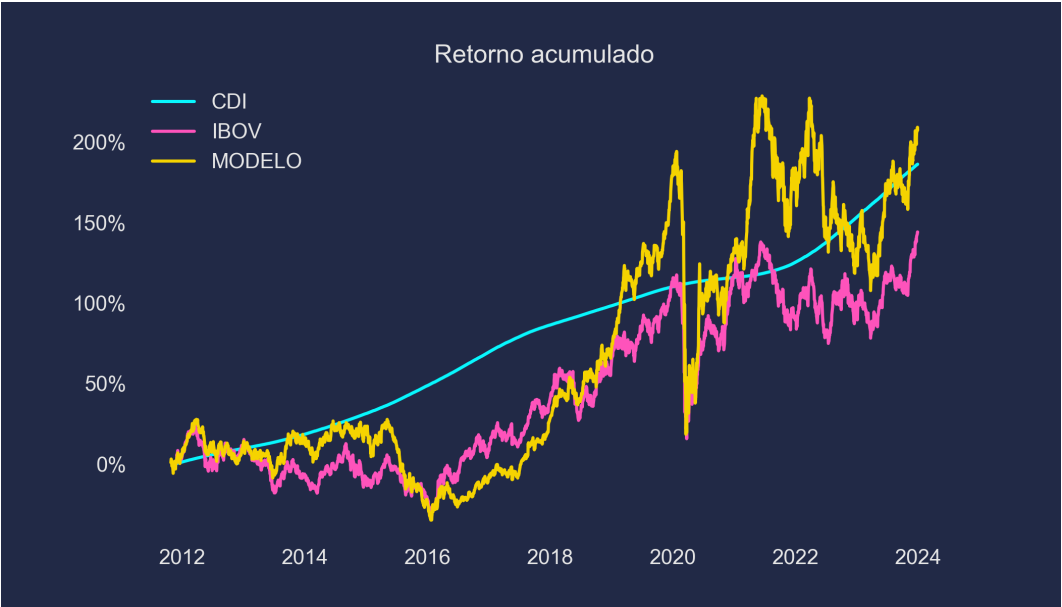


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-24
Dia final	2023-12-28
Dias totais	3016

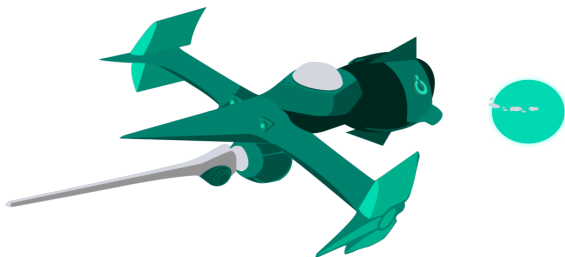


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	207.33%
Retorno acum. CDI	186.21%
Retorno acum. IBOV	144.1%
Retorno a.a. modelo	9.84%
Vol 252d	22.87%
Índice Sharpe	0.02
VAR diário 95%	-2.46%
Turn over carteira	20.49%
Drawdown máximo	-59.74%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	144
% Operações vencedoras	56.94%
% Operações perdedoras	43.06%
Média de ganhos	5.54%
Média de perdas	-4.81%
Expec. matemática por trade	1.08%
Maior sequência de vitória	9
Maior sequência de derrotas	8
% Meses carteira > IBOV	48.97%



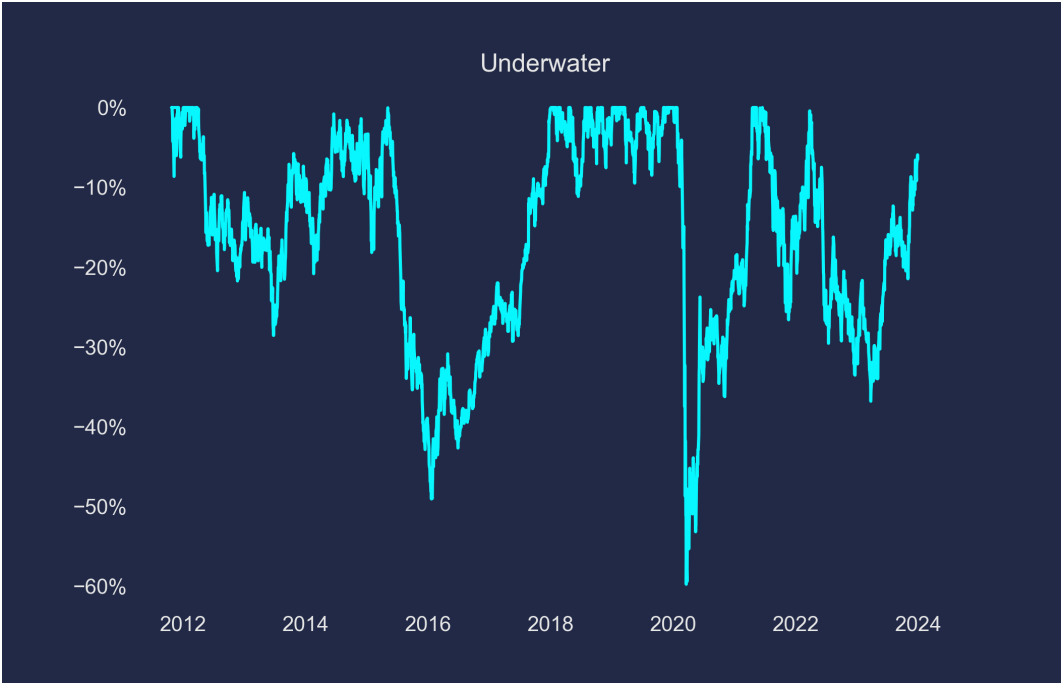
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

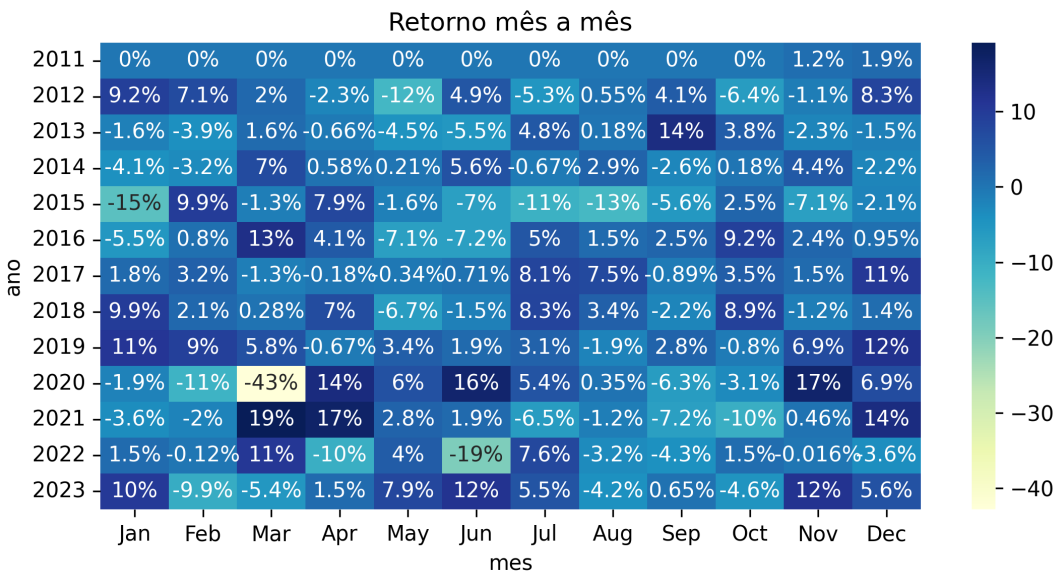
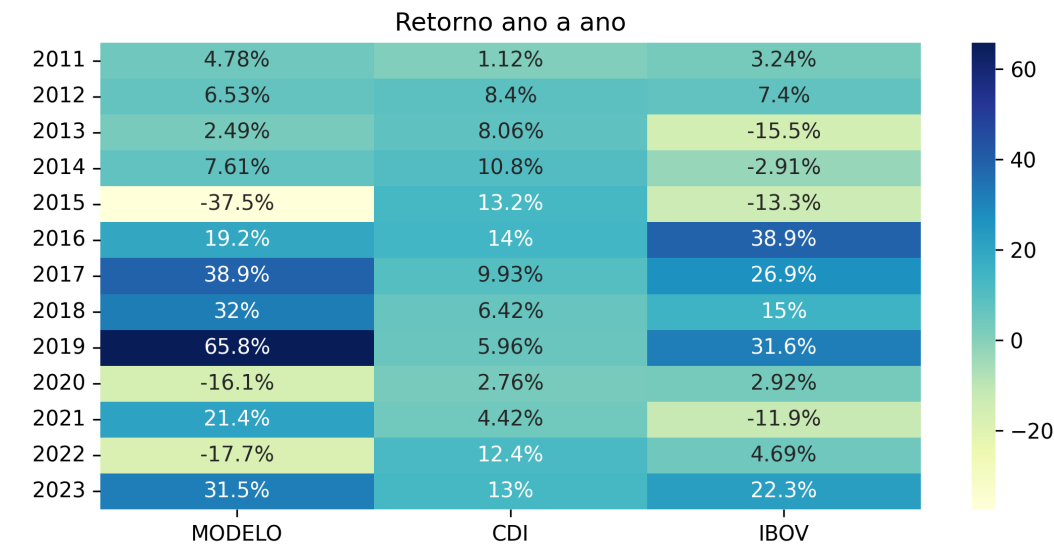
Joesley Day - 18/05/2017	-6.36%
Auge pandemia: Março - 2020	-44.41%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.56%
Greve dos caminhoneiros - 2018	1.56%
Precatórios - ago/nov 2021	-18.32%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-57.68%
Pior período de 3 meses	-54.75%
Pior período de 6 meses	-49.78%
Pior período de 1 ano	-46.38%
Pior período de 2 anos	-43.3%
Pior período de 3 anos	-42.33%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

