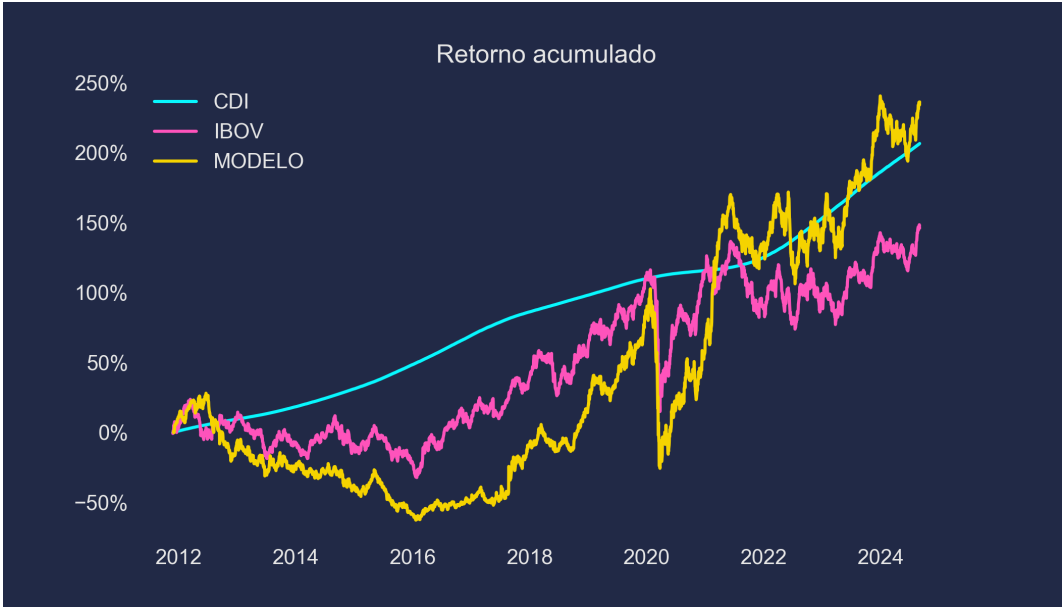


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-25
Dia final	2024-08-30
Dias totais	3163

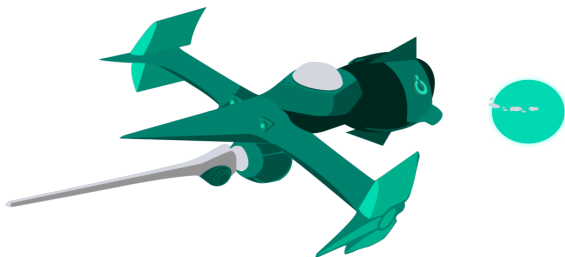


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	236.23%
Retorno acum. CDI	206.51%
Retorno acum. IBOV	146.03%
Retorno a.a. modelo	10.14%
Vol 252d	15.34%
Índice Sharpe	0.03
VAR diário 95%	-2.76%
Turn over carteira	22.7%
Drawdown máximo	-70.81%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	141
% Operações vencedoras	52.48%
% Operações perdedoras	47.52%
Média de ganhos	7.15%
Média de perdas	-5.3%
Expec. matemática por trade	1.24%
Maior sequência de vitória	8
Maior sequência de derrotas	7
% Meses carteira > IBOV	54.93%



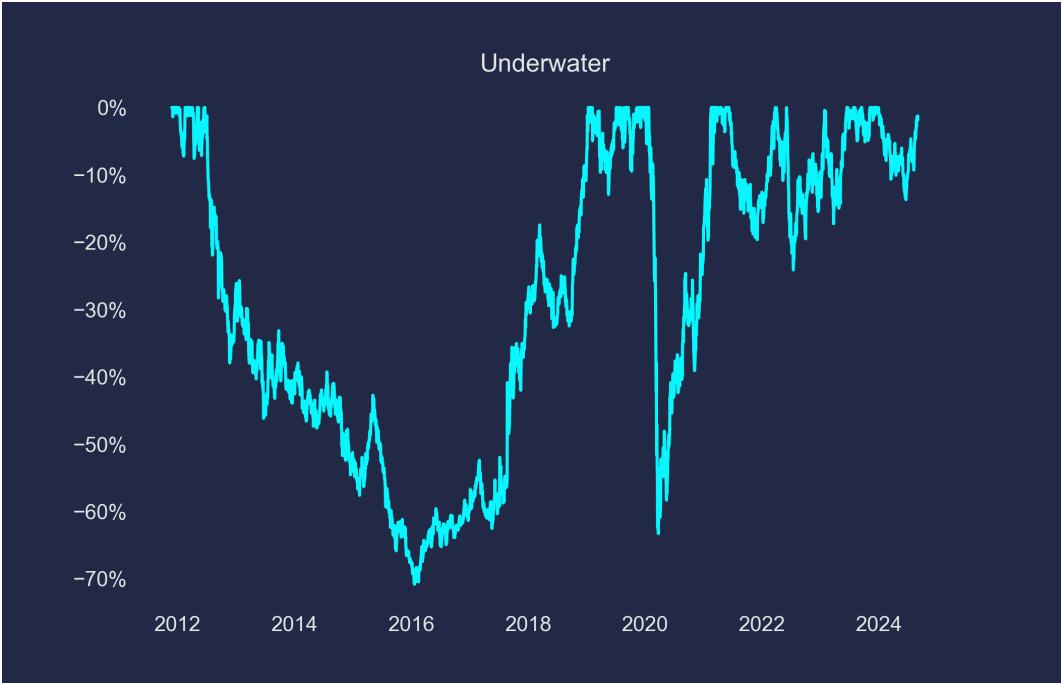
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

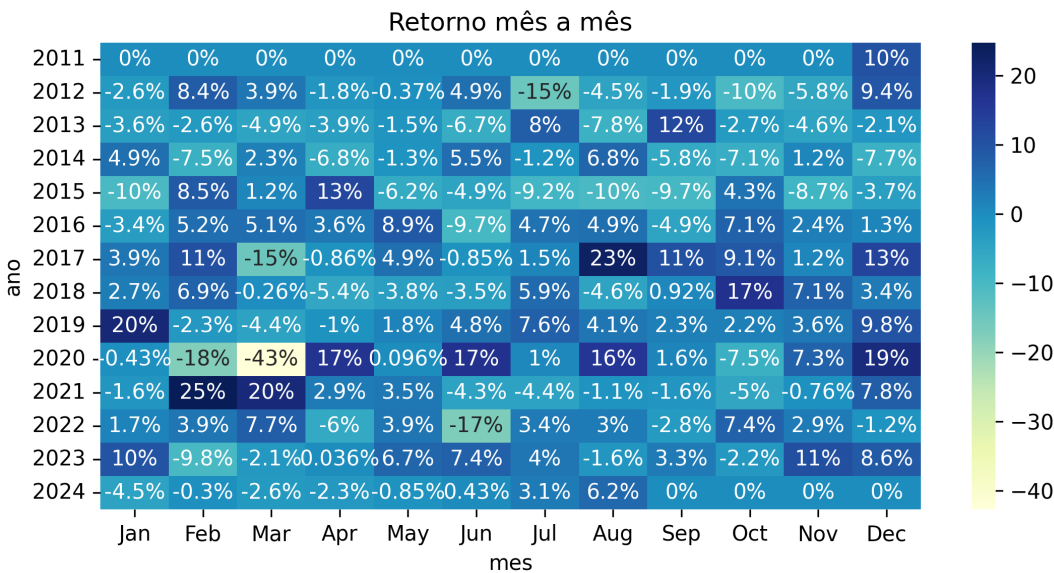
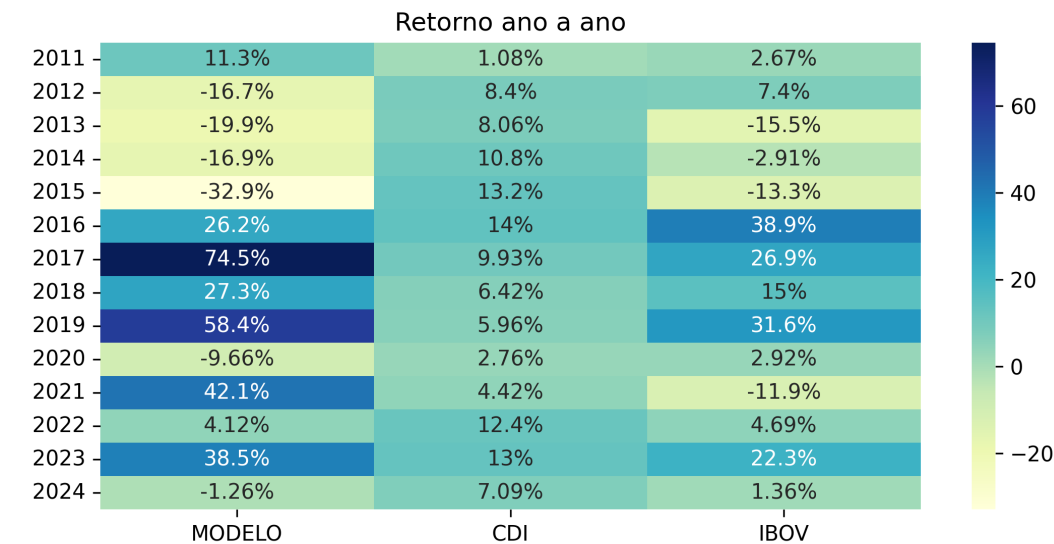
Joesley Day - 18/05/2017	-4.76%
Auge pandemia: Março - 2020	-43.99%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-2.79%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-6.63%
Precatórios - ago/nov 2021	-7.32%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-59.2%
Pior período de 3 meses	-58.24%
Pior período de 6 meses	-53.62%
Pior período de 1 ano	-46.9%
Pior período de 2 anos	-51.94%
Pior período de 3 anos	-60.24%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

