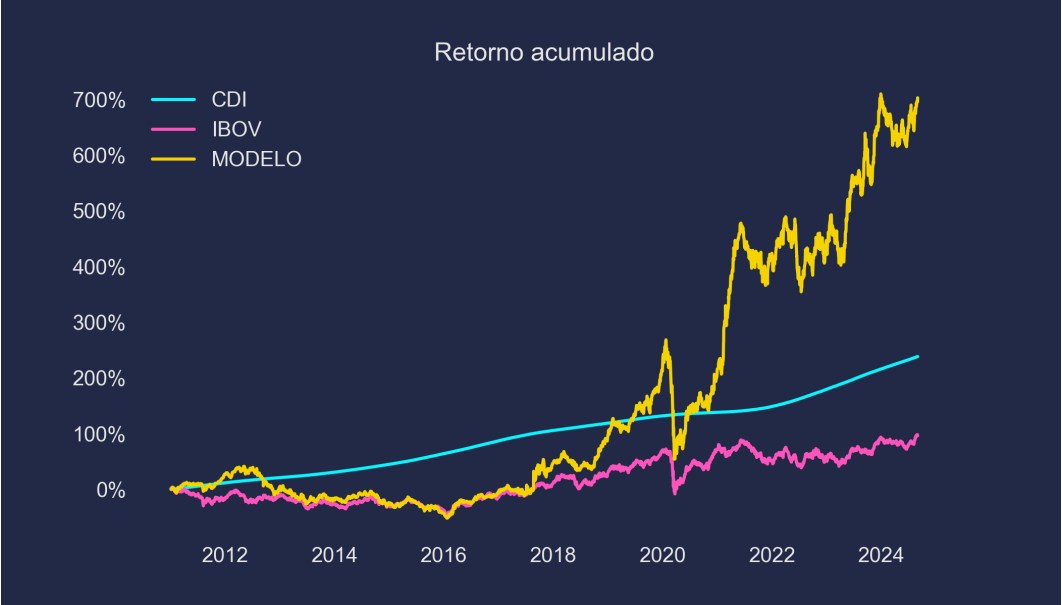


# Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-01-03
Dia final	2024-08-30
Dias totais	3387

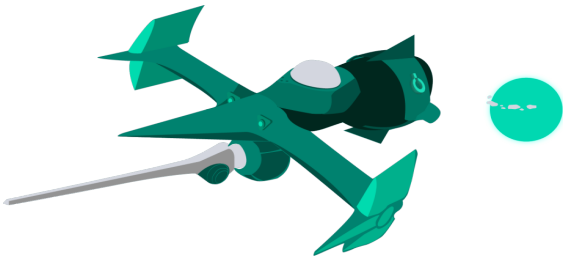


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	702.87%
Retorno acum. CDI	238.41%
Retorno acum. IBOV	96.24%
Retorno a.a. modelo	16.76%
Vol 252d	17.13%
Índice Sharpe	0.25
VAR diário 95%	-2.46%
Turn over carteira	22.52%
Drawdown máximo	-65.82%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	152
% Operações vencedoras	57.24%
% Operações perdedoras	42.76%
Média de ganhos	7.64%
Média de perdas	-6.0%
Expec. matemática por trade	1.81%
Maior sequência de vitória	8
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	60.13%



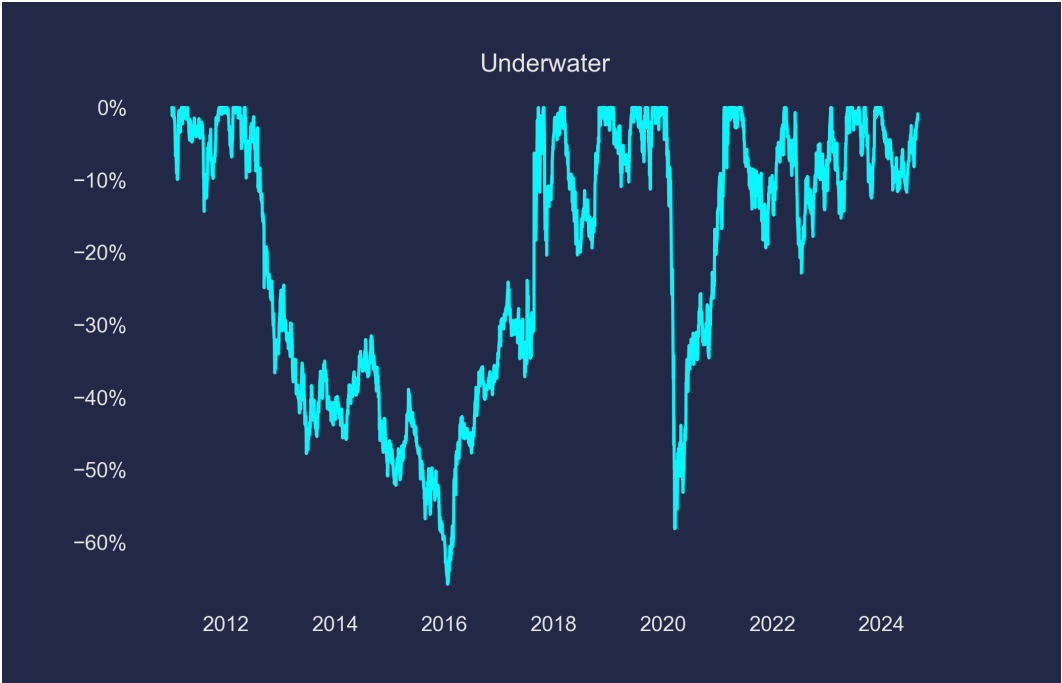
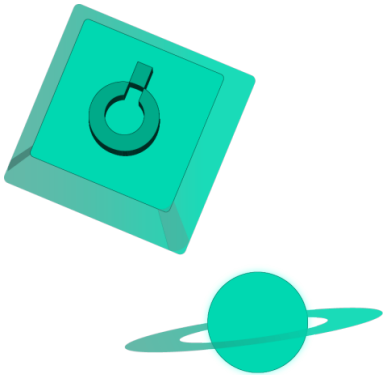
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

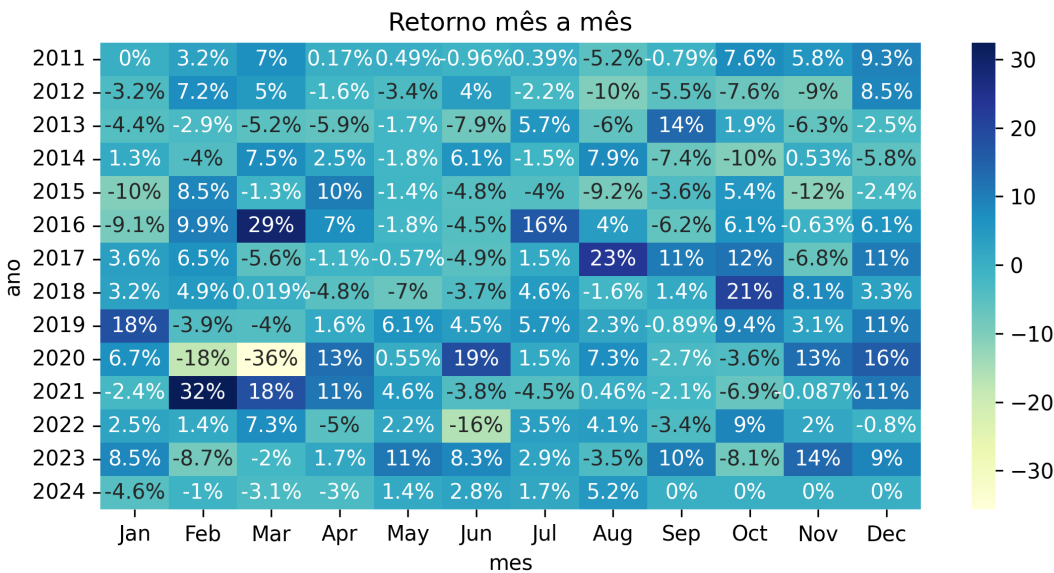
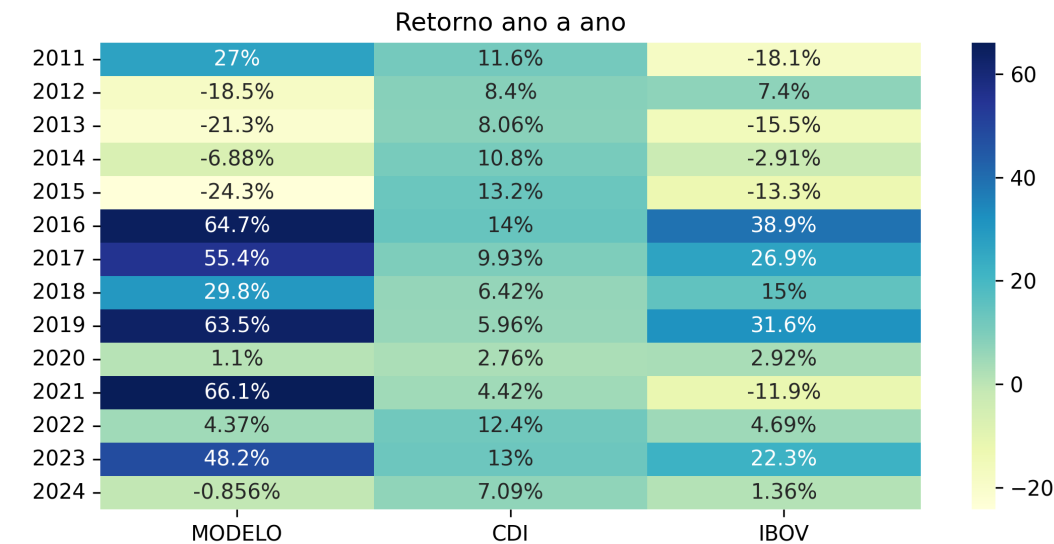
Joesley Day - 18/05/2017	-4.76%
Auge pandemia: Março - 2020	-37.12%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.25%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-9.26%
Precatórios - ago/nov 2021	-7.67%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-54.28%
Pior período de 3 meses	-51.47%
Pior período de 6 meses	-40.18%
Pior período de 1 ano	-45.64%
Pior período de 2 anos	-42.84%
Pior período de 3 anos	-53.81%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

