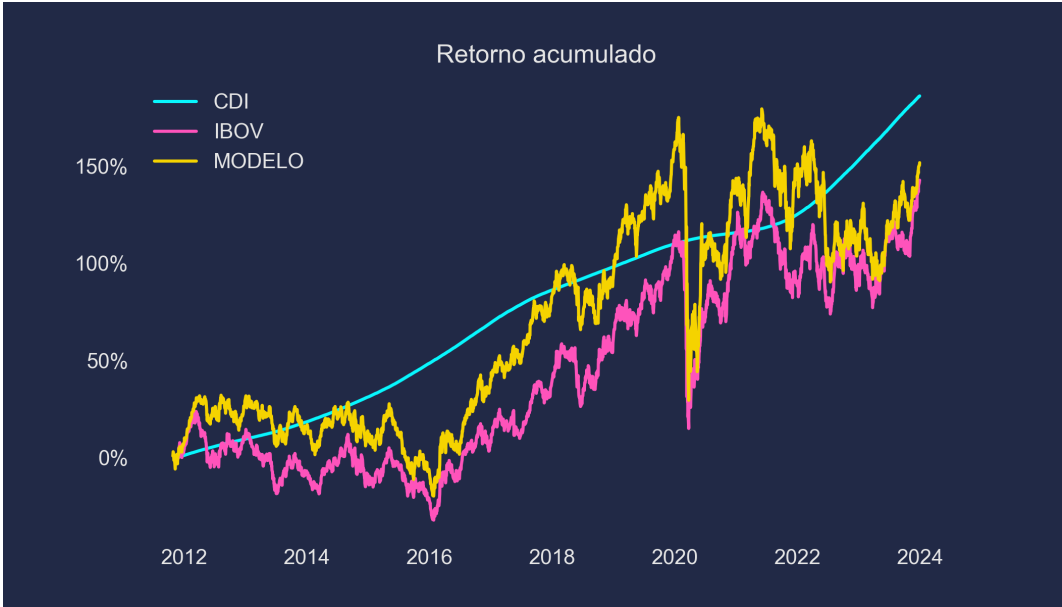


Relatório do Modelo

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

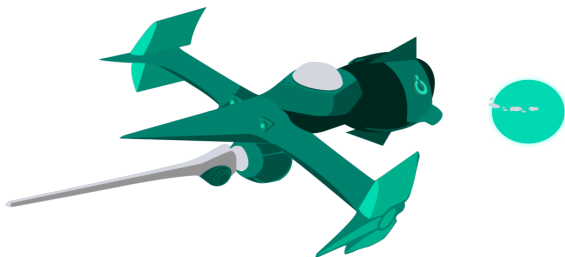


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	151.74%
Retorno acum. CDI	186.09%
Retorno acum. IBOV	142.74%
Retorno a.a. modelo	8.02%
Vol 252d	17.91%
Índice Sharpe	-0.05
VAR diário 95%	-2.18%
Turn over carteira	15.48%
Drawdown máximo	-52.91%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	138
% Operações vencedoras	54.35%
% Operações perdedoras	45.65%
Média de ganhos	5.7%
Média de perdas	-4.76%
Expec. matemática por trade	0.92%
Maior sequência de vitória	5
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	52.52%



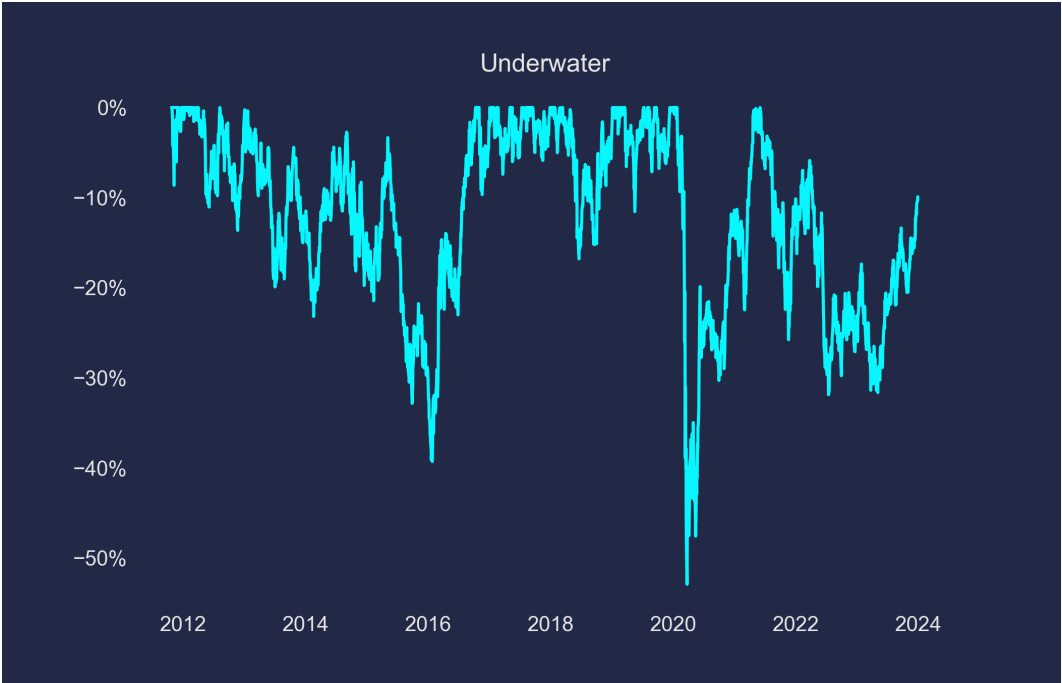
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

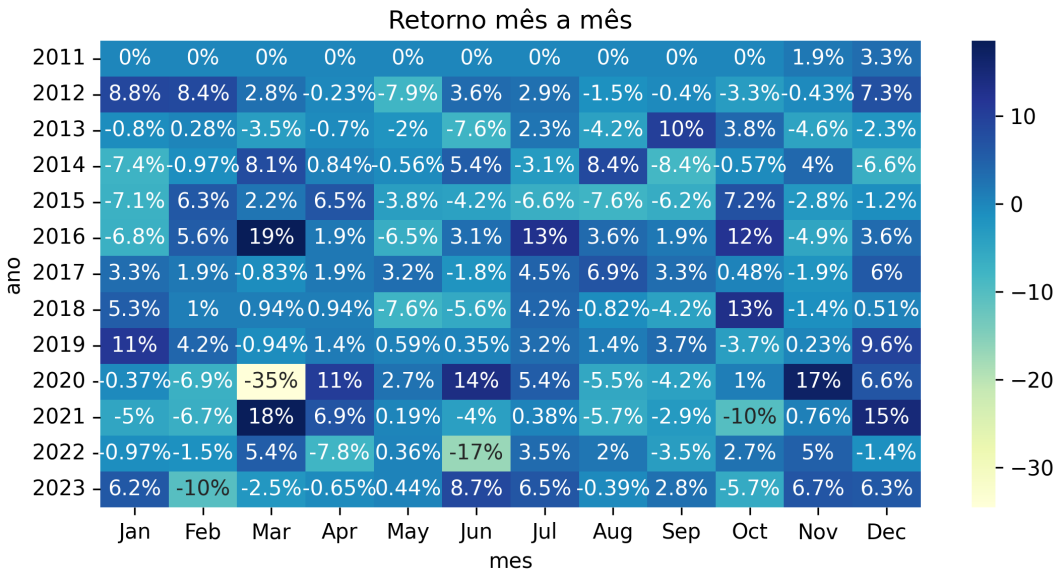
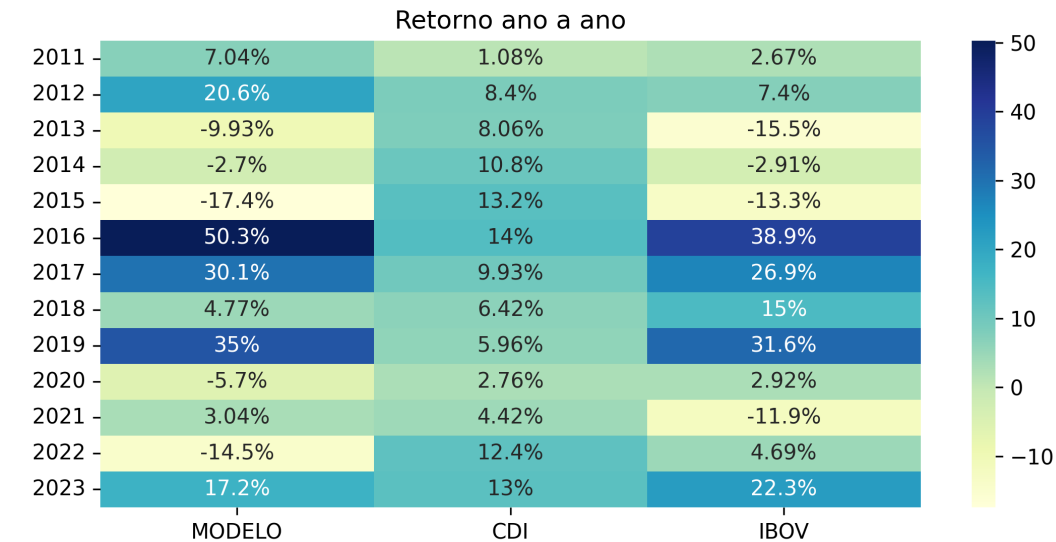
Joesley Day - 18/05/2017	-4.37%
Auge pandemia: Março - 2020	-36.61%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-2.31%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-4.92%
Precatórios - ago/nov 2021	-16.97%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-51.37%
Pior período de 3 meses	-48.72%
Pior período de 6 meses	-46.66%
Pior período de 1 ano	-43.61%
Pior período de 2 anos	-33.45%
Pior período de 3 anos	-39.13%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

