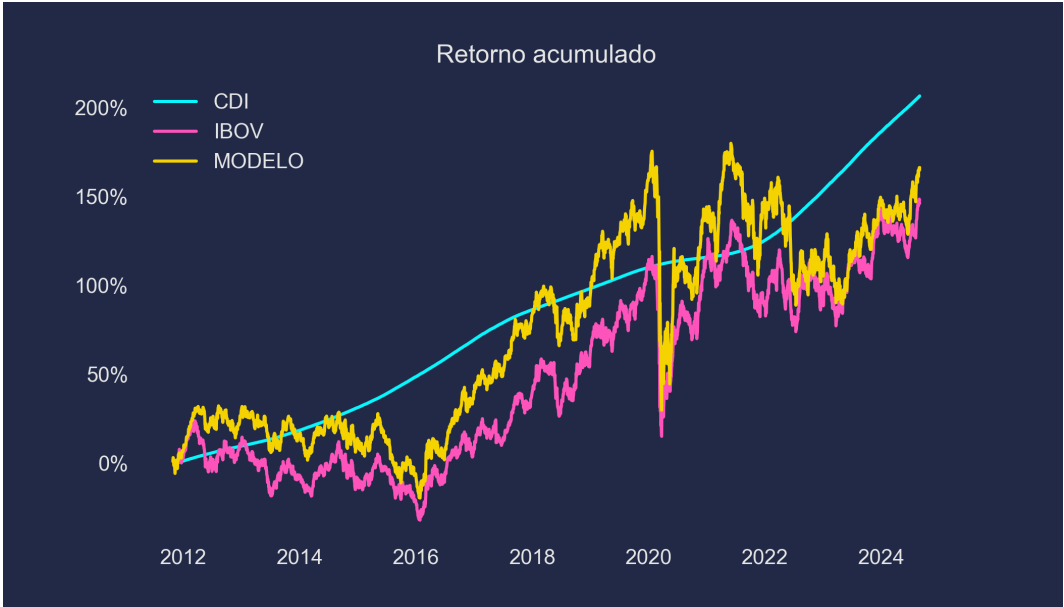


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-25
Dia final	2024-08-30
Dias totais	3185

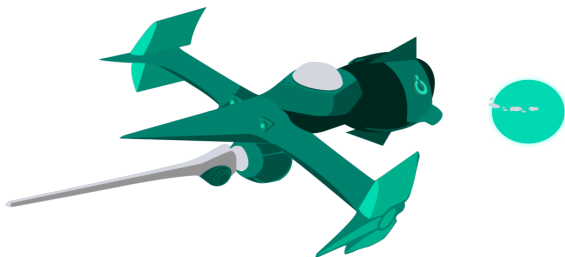


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	166.22%
Retorno acum. CDI	206.51%
Retorno acum. IBOV	146.03%
Retorno a.a. modelo	8.06%
Vol 252d	13.69%
Índice Sharpe	-0.05
VAR diário 95%	-2.15%
Turn over carteira	15.67%
Drawdown máximo	-52.93%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	145
% Operações vencedoras	55.17%
% Operações perdedoras	44.83%
Média de ganhos	5.54%
Média de perdas	-4.76%
Expec. matemática por trade	0.92%
Maior sequência de vitória	5
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	53.42%



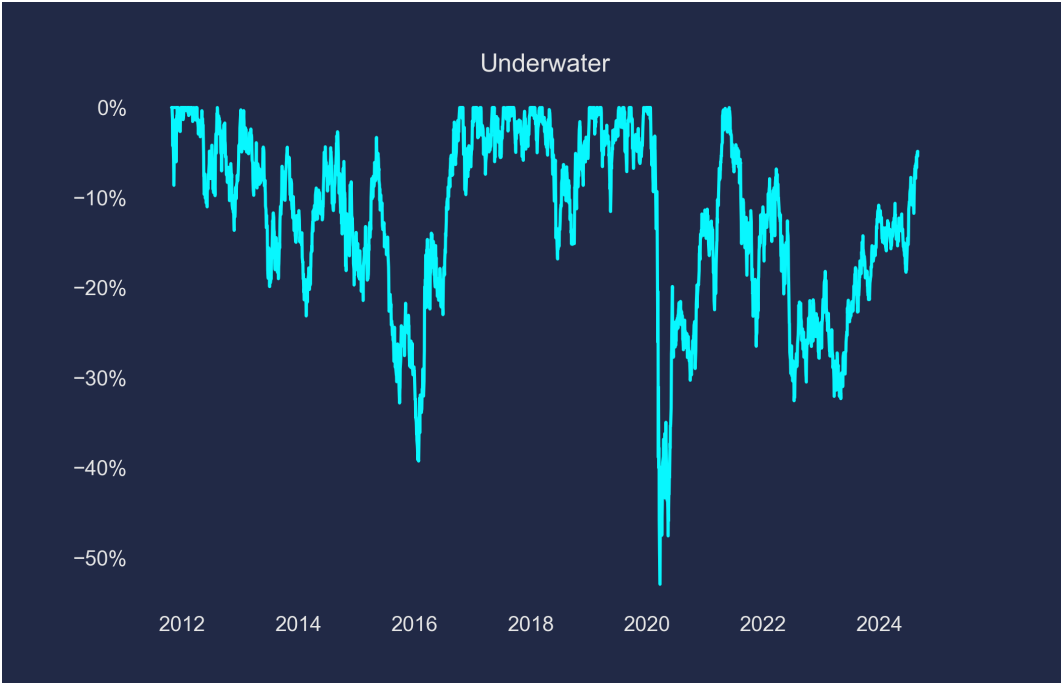
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

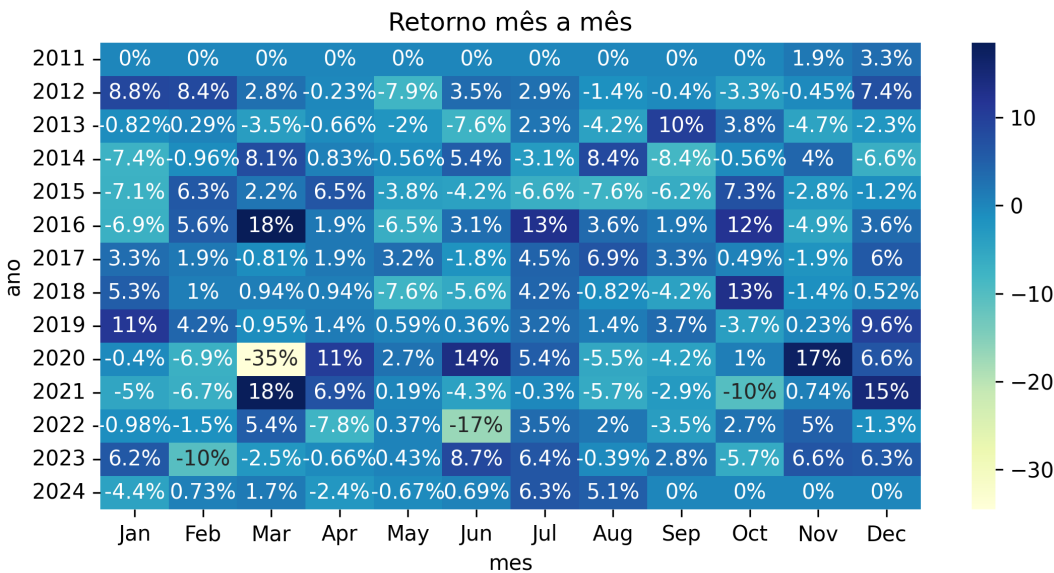
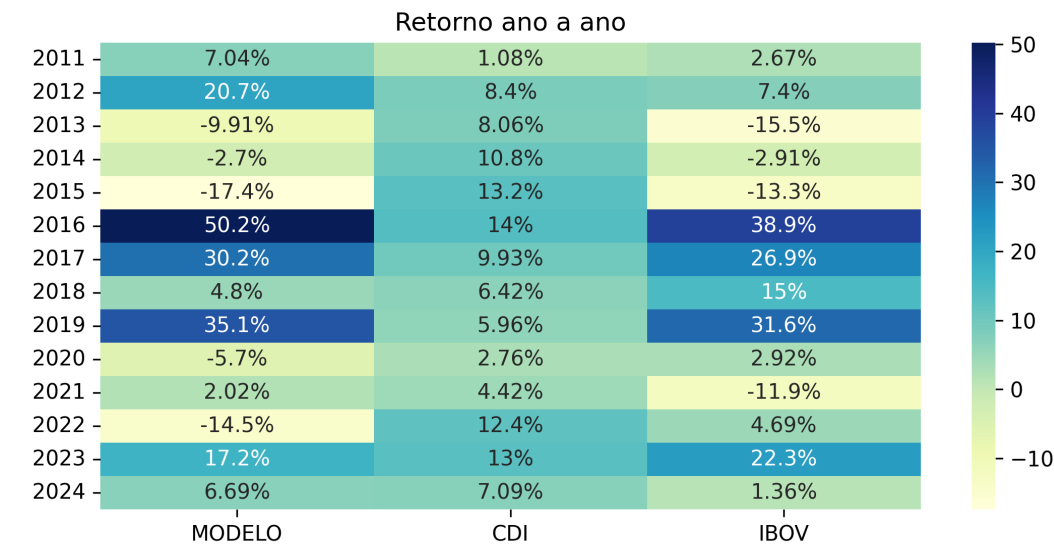
Joesley Day - 18/05/2017	-4.4%
Auge pandemia: Março - 2020	-36.61%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-2.32%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-4.93%
Precatórios - ago/nov 2021	-16.98%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-51.39%
Pior período de 3 meses	-48.75%
Pior período de 6 meses	-46.68%
Pior período de 1 ano	-43.62%
Pior período de 2 anos	-33.45%
Pior período de 3 anos	-39.09%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

