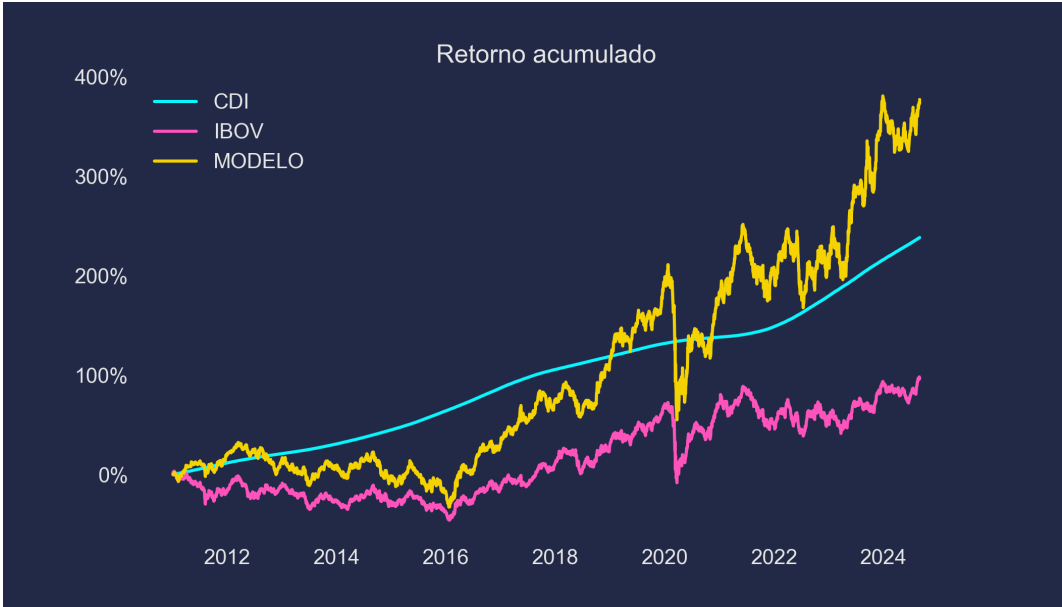


Relatório do Modelo

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

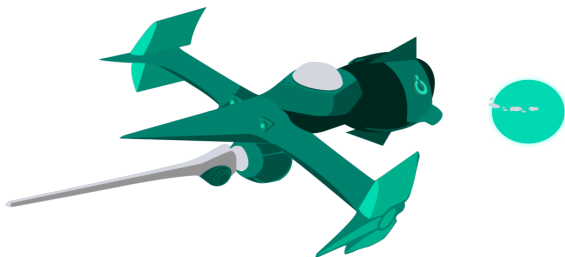


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	377.2%
Retorno acum. CDI	238.41%
Retorno acum. IBOV	96.24%
Retorno a.a. modelo	12.33%
Vol 252d	16.82%
Índice Sharpe	0.12
VAR diário 95%	-2.14%
Turn over carteira	18.4%
Drawdown máximo	-50.18%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	154
% Operações vencedoras	55.84%
% Operações perdedoras	44.16%
Média de ganhos	6.3%
Média de perdas	-4.99%
Expec. matemática por trade	1.31%
Maior sequência de vitória	8
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	55.48%



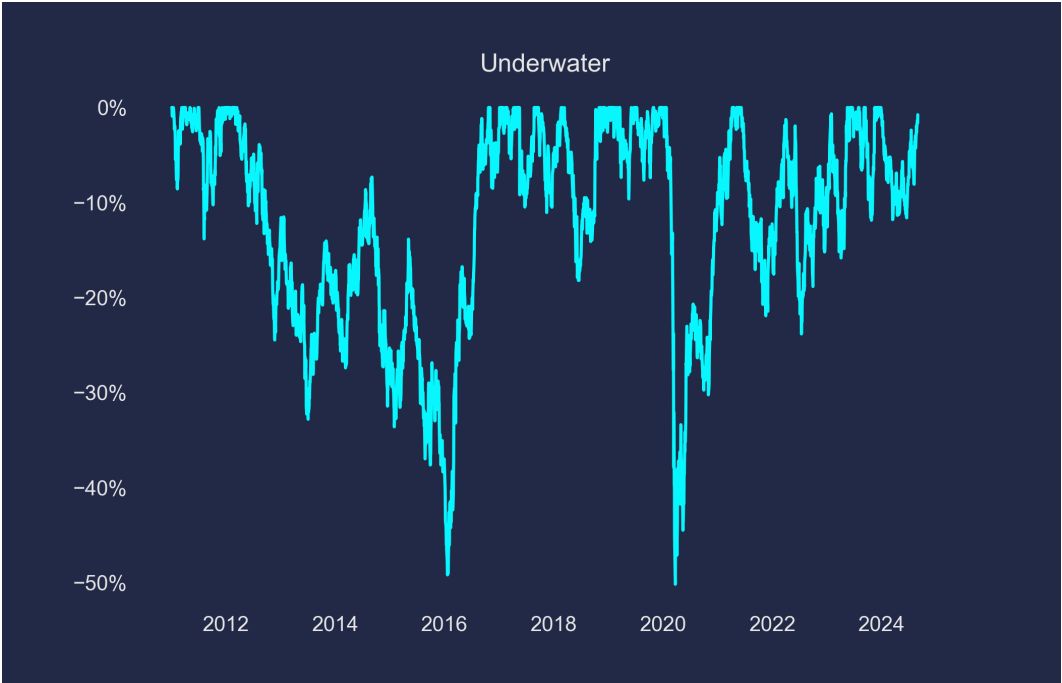
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

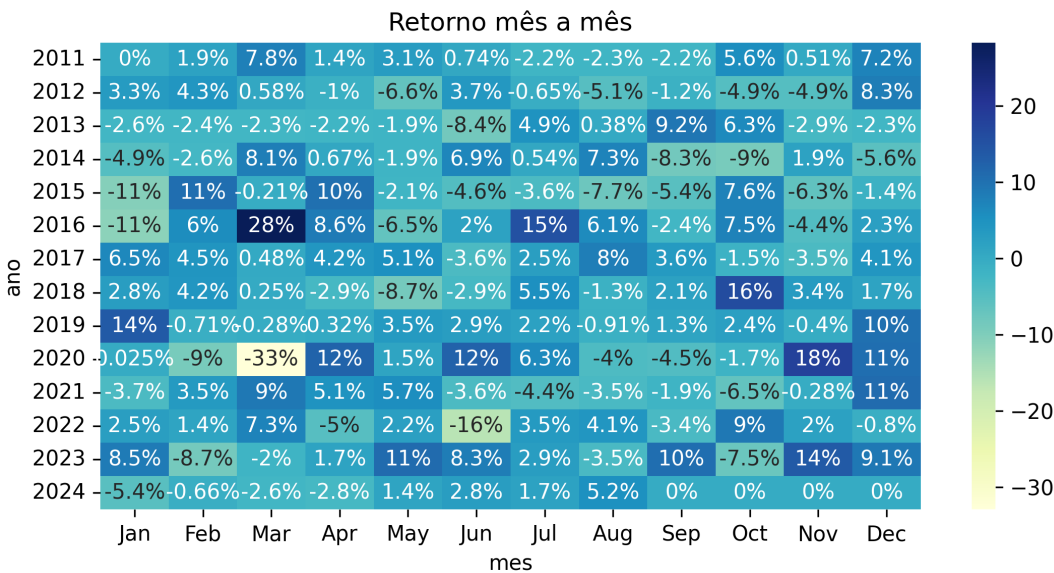
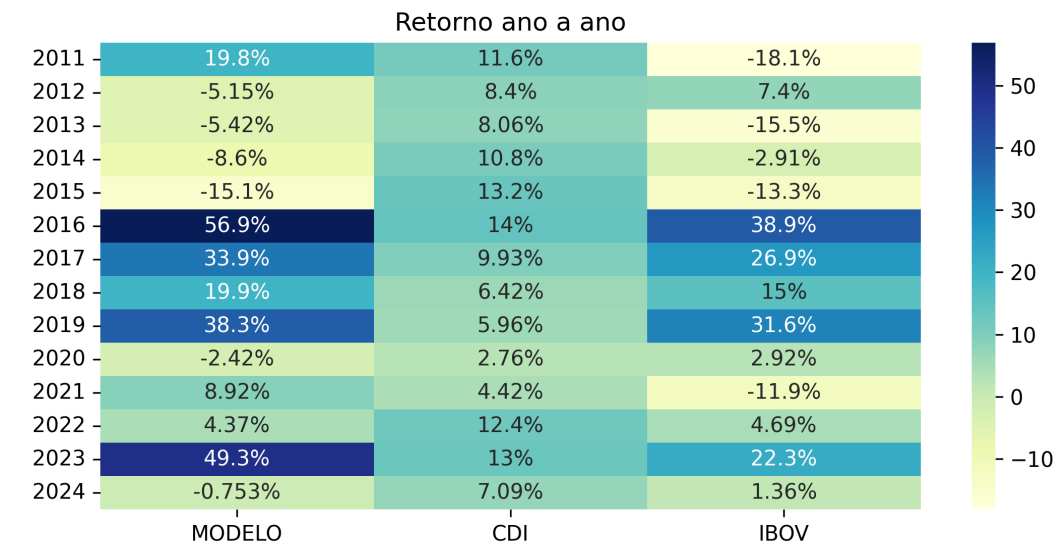
Joesley Day - 18/05/2017	-8.2%
Auge pandemia: Março - 2020	-34.39%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-3.25%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-9.77%
Precatórios - ago/nov 2021	-10.84%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-47.44%
Pior período de 3 meses	-44.82%
Pior período de 6 meses	-40.33%
Pior período de 1 ano	-37.21%
Pior período de 2 anos	-37.79%
Pior período de 3 anos	-42.34%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

