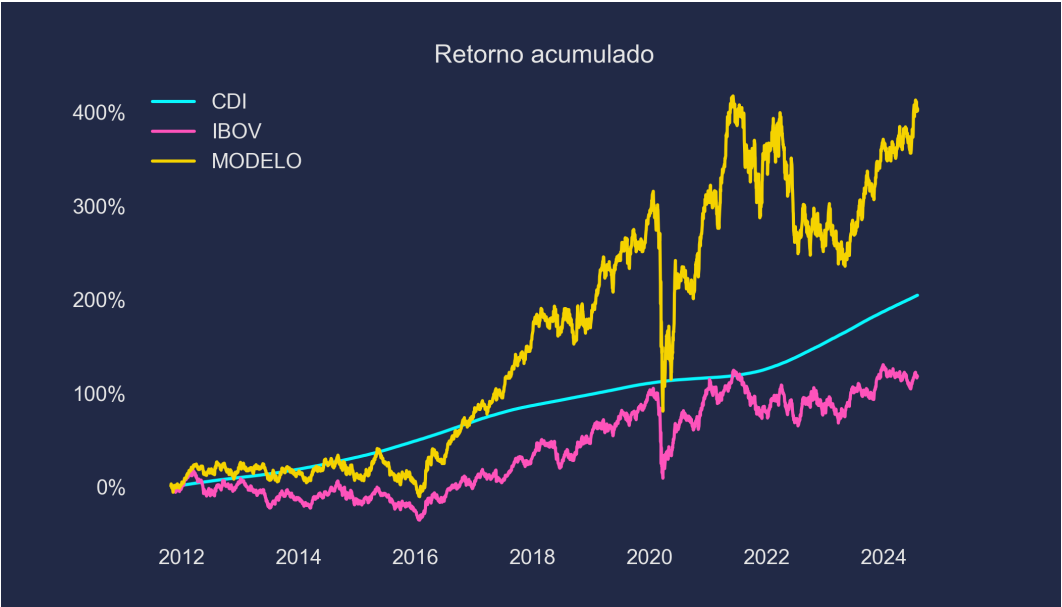


# Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-16
Dia final	2024-07-30
Dias totais	3162

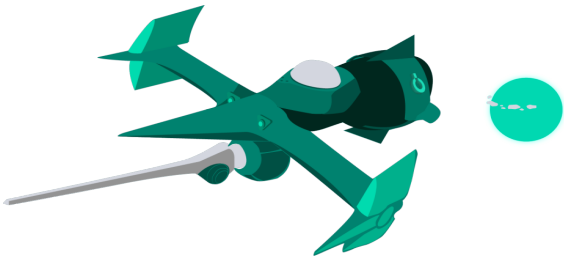


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	403.38%
Retorno acum. CDI	204.55%
Retorno acum. IBOV	117.92%
Retorno a.a. modelo	13.75%
Vol 252d	14.69%
Índice Sharpe	0.18
VAR diário 95%	-2.27%
Turn over carteira	15.07%
Drawdown máximo	-56.51%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	211
% Operações vencedoras	57.35%
% Operações perdedoras	42.65%
Média de ganhos	5.01%
Média de perdas	-4.38%
Expec. matemática por trade	1.01%
Maior sequência de vitória	13
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	54.72%



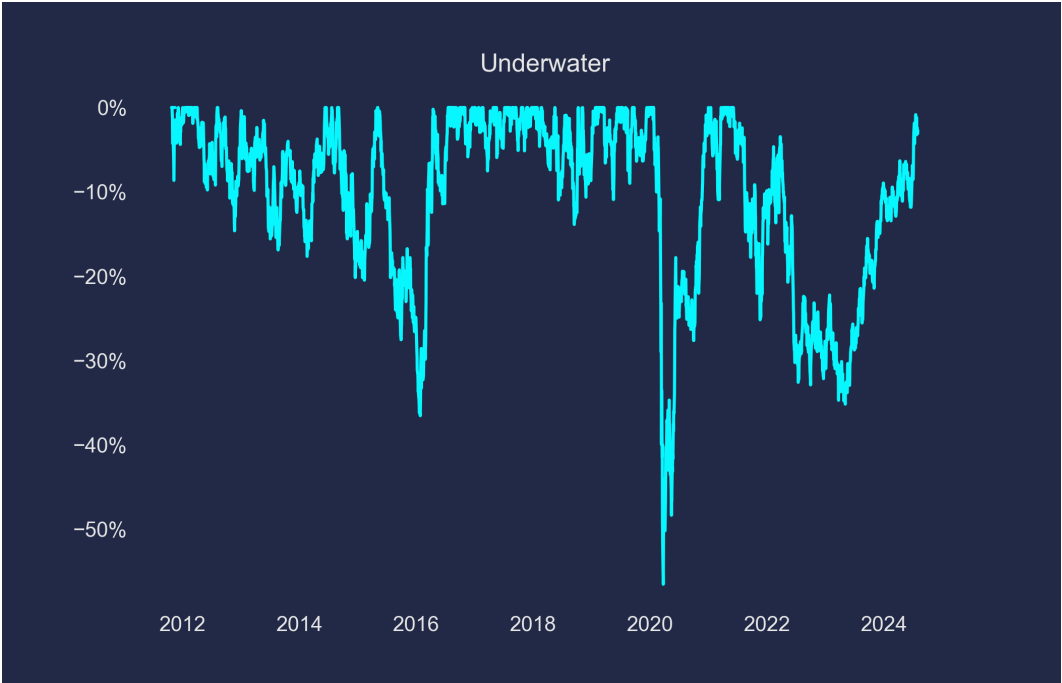
# Relatório do Modelo

Eventos de estresse

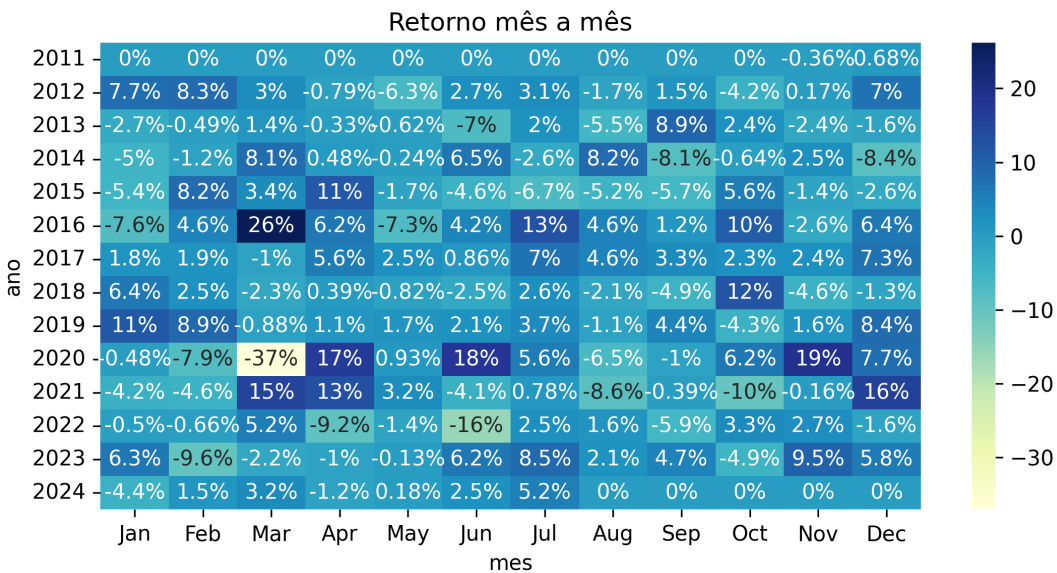
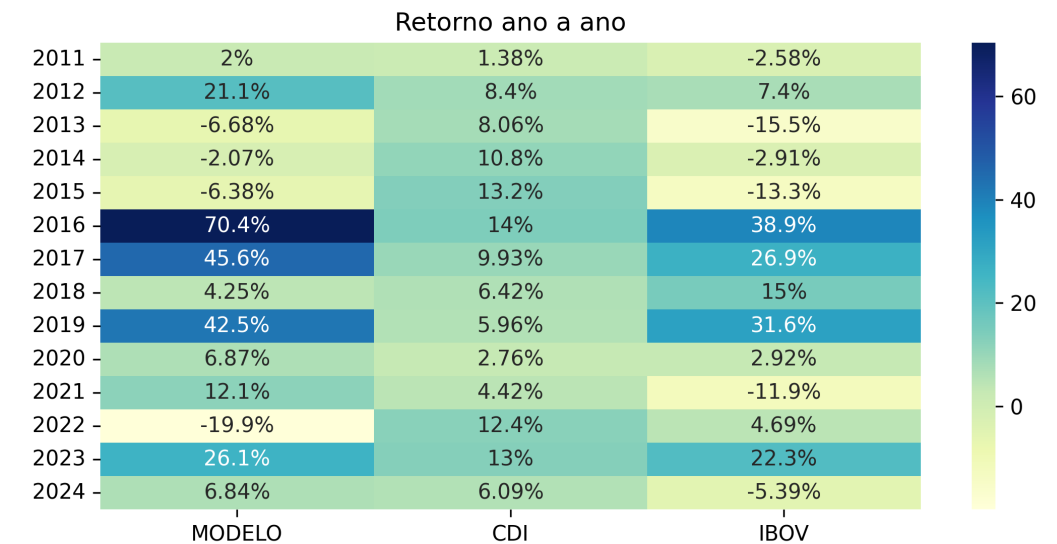
Joesley Day - 18/05/2017	-4.06%
Auge pandemia: Março - 2020	-39.29%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-2.43%
Greve dos caminhoneiros - 2018	2.05%
Precatórios - ago/nov 2021	-17.12%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-54.95%
Pior período de 3 meses	-52.79%
Pior período de 6 meses	-51.14%
Pior período de 1 ano	-47.65%
Pior período de 2 anos	-35.62%
Pior período de 3 anos	-29.11%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

