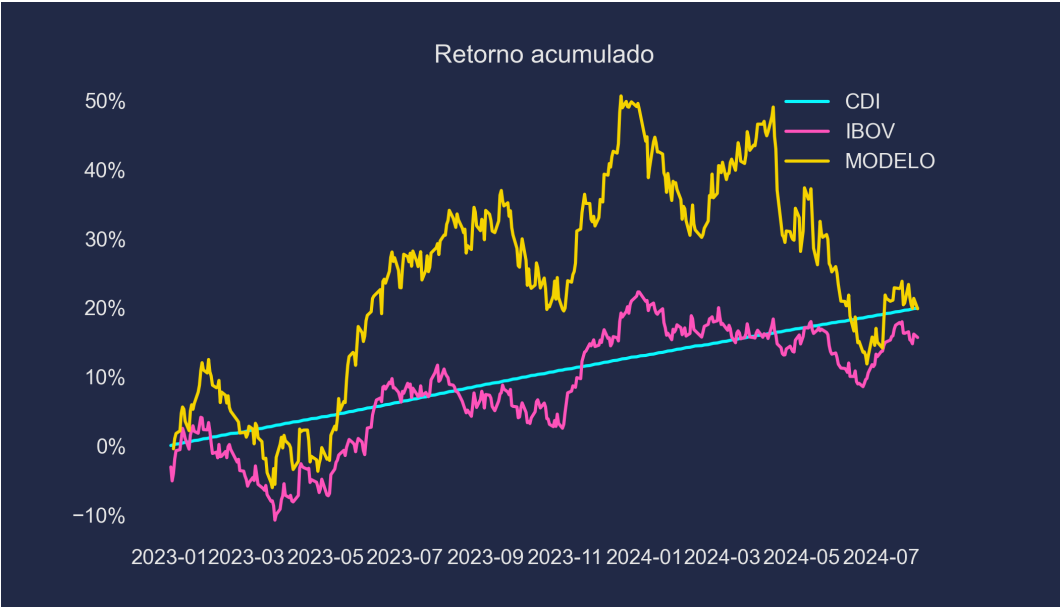


Relatório do Modelo

Dia inicial	2023-01-02
Dia final	2024-07-29
Dias totais	392

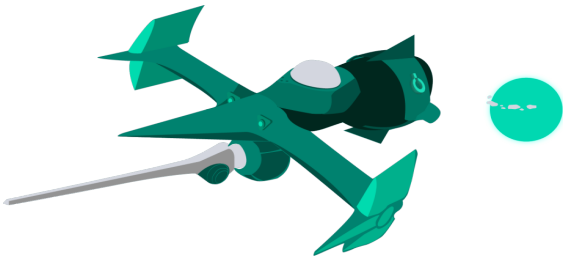


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	19.85%
Retorno acum. CDI	19.92%
Retorno acum. IBOV	15.69%
Retorno a.a. modelo	12.35%
Vol 252d	24.49%
Índice Sharpe	-0.0
VAR diário 95%	-2.47%
Turn over carteira	24.21%
Drawdown máximo	-25.76%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	18
% Operações vencedoras	61.11%
% Operações perdedoras	38.89%
Média de ganhos	6.81%
Média de perdas	-7.25%
Expec. matemática por trade	1.34%
Maior sequência de vitória	5
Maior sequência de derrotas	2
% Meses carteira > IBOV	52.63%



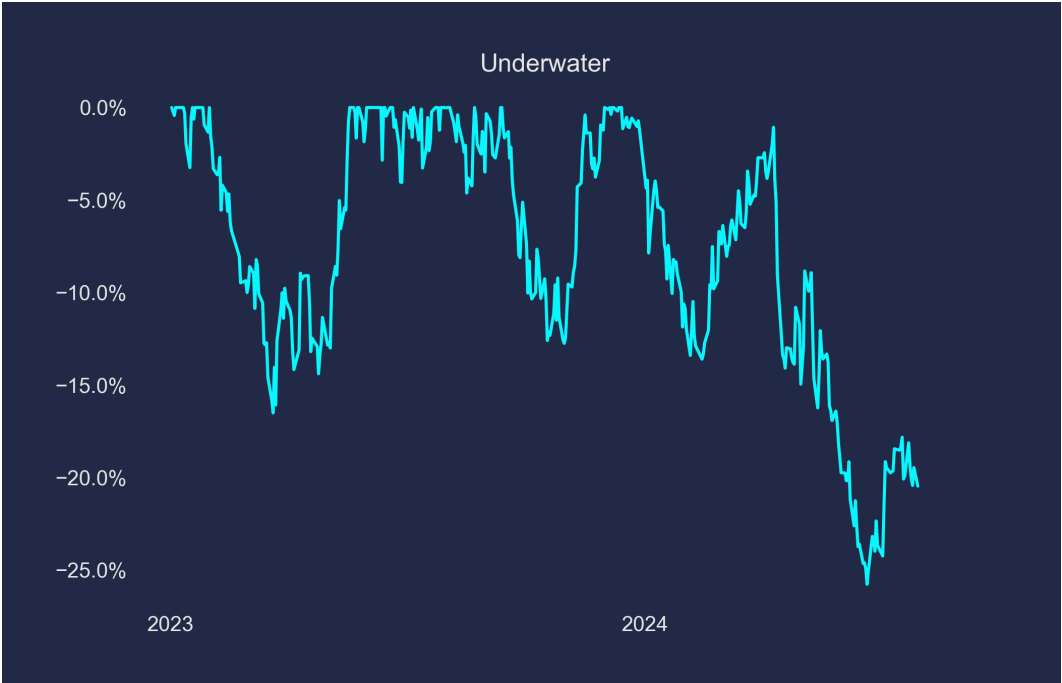
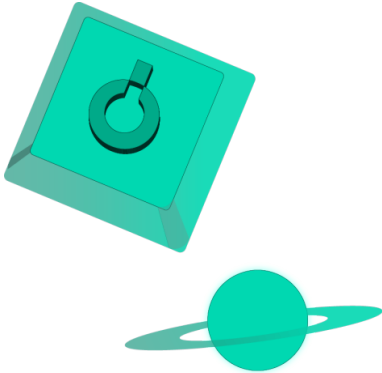
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

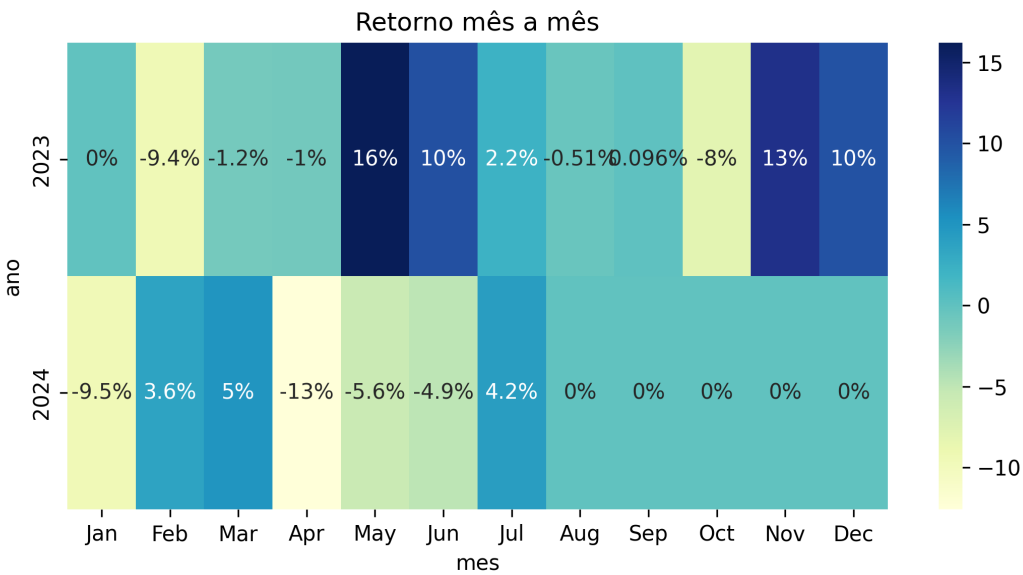
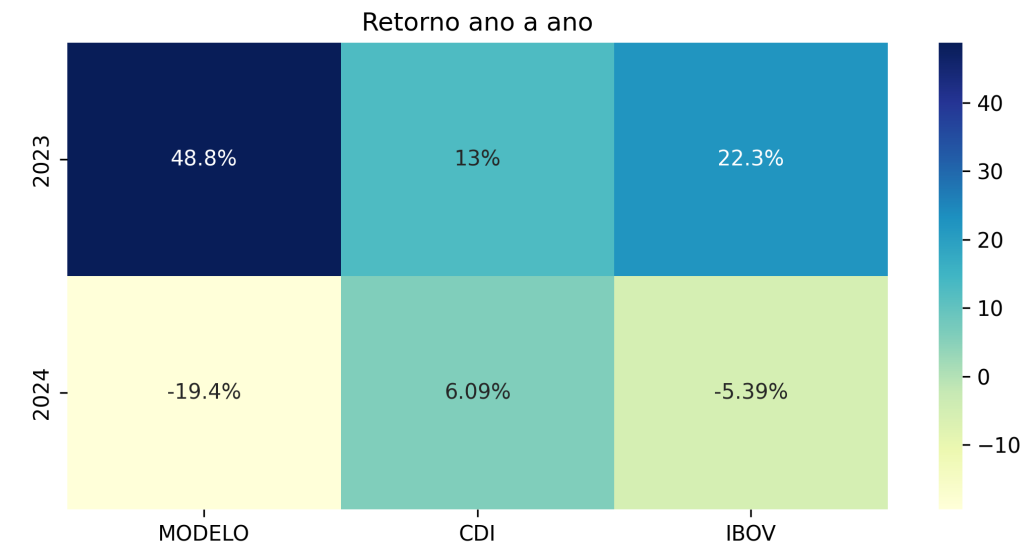
Joesley Day - 18/05/2017	-
Auge pandemia: Março - 2020	-
Boa sorte Day - 10/11/2022	-
Greve dos caminhoneiros - 2018	-
Precatórios - ago/nov 2021	-
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-13.9%
Pior período de 3 meses	-23.12%
Pior período de 6 meses	-24.94%
Pior período de 1 ano	-9.83%
Pior período de 2 anos	nan%
Pior período de 3 anos	nan%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

