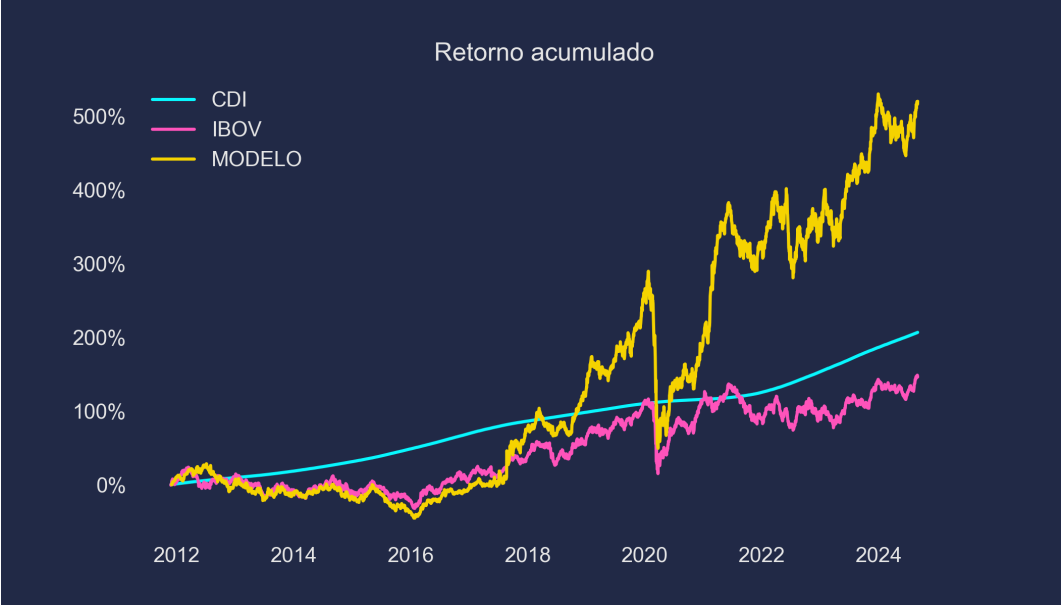


# Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-25
Dia final	2024-08-30
Dias totais	3163

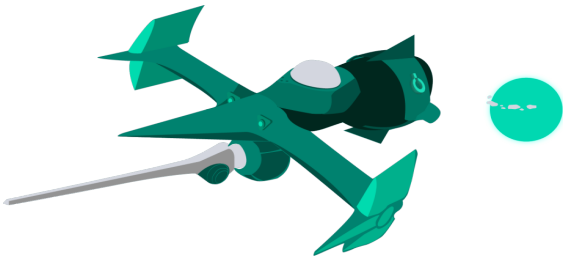


## Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	519.86%
Retorno acum. CDI	206.51%
Retorno acum. IBOV	146.03%
Retorno a.a. modelo	15.64%
Vol 252d	14.87%
Índice Sharpe	0.22
VAR diário 95%	-2.47%
Turn over carteira	22.03%
Drawdown máximo	-61.66%

## Estatísticas de Trade

Número de carteiras	141
% Operações vencedoras	56.74%
% Operações perdedoras	43.26%
Média de ganhos	6.79%
Média de perdas	-5.11%
Expec. matemática por trade	1.64%
Maior sequência de vitória	8
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	57.75%



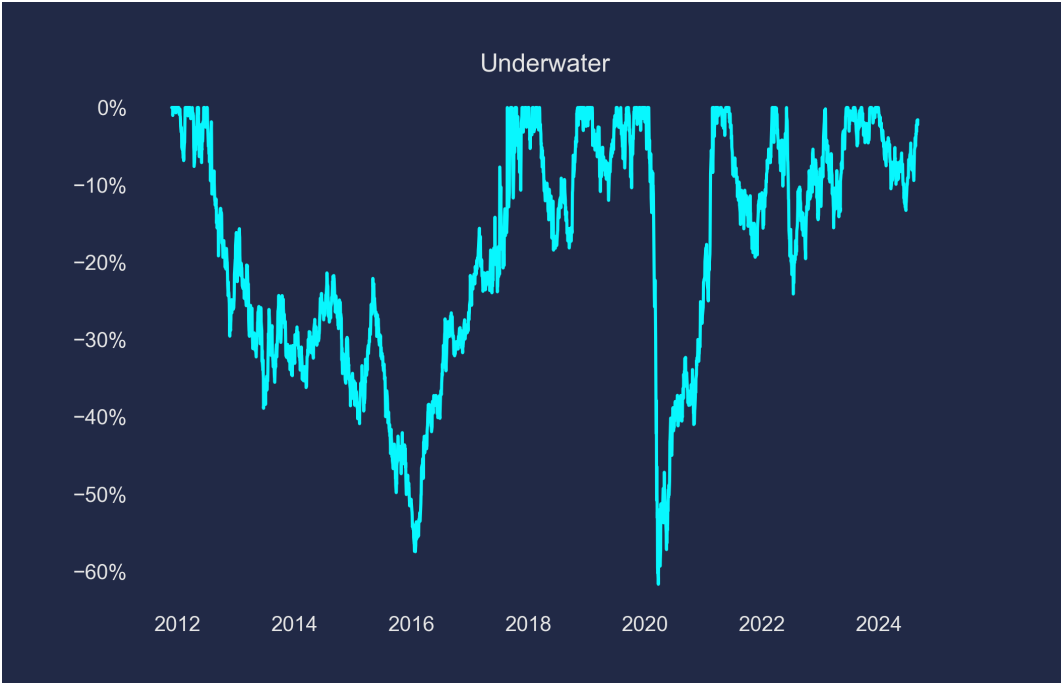
# Relatório do Modelo

## Eventos de estresse

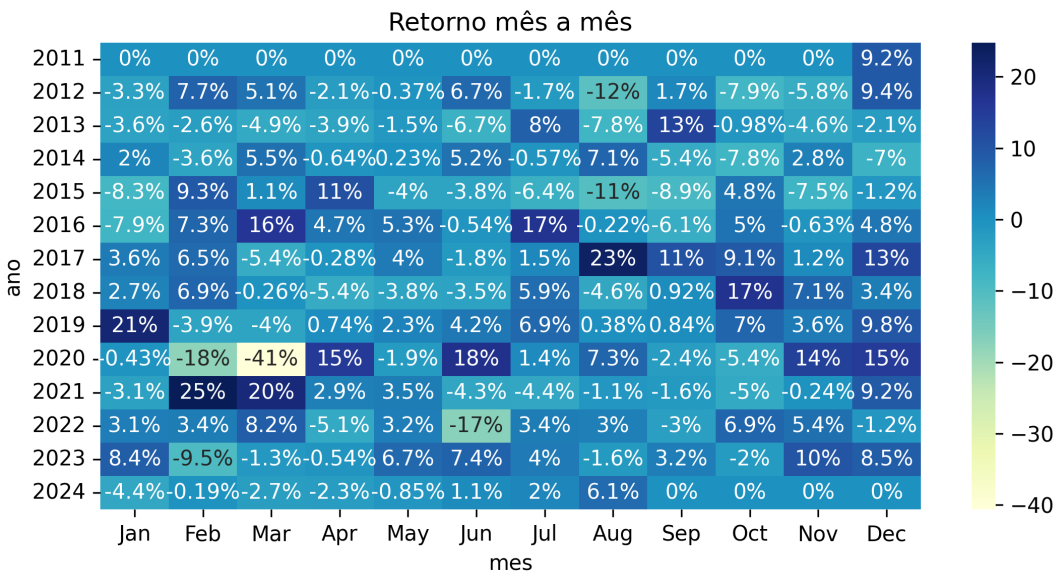
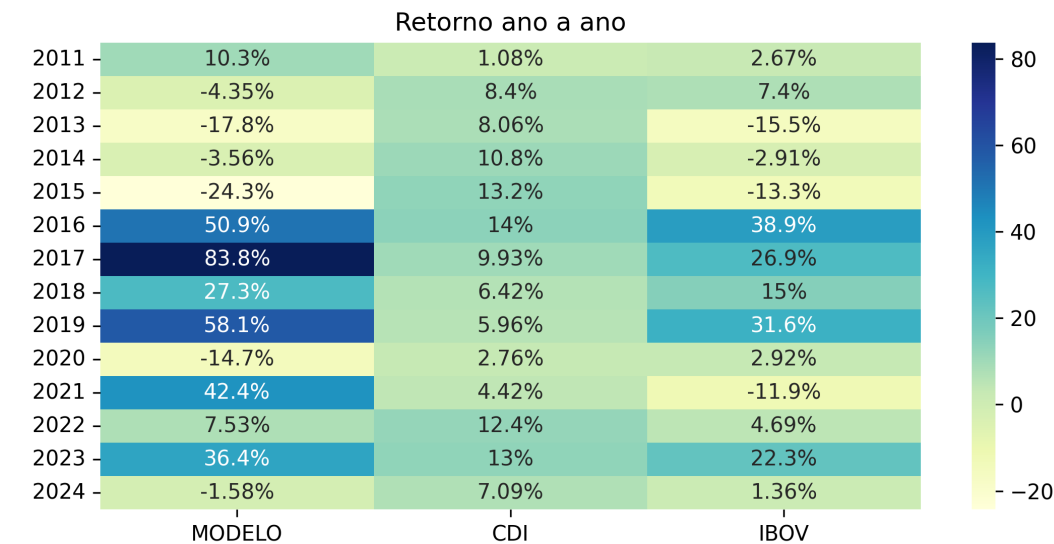
Joesley Day - 18/05/2017	-5.25%
Auge pandemia: Março - 2020	-41.97%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-2.24%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-6.63%
Precatórios - ago/nov 2021	-7.32%
Crise de 2008	-

## Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-57.4%
Pior período de 3 meses	-56.58%
Pior período de 6 meses	-49.66%
Pior período de 1 ano	-44.03%
Pior período de 2 anos	-39.54%
Pior período de 3 anos	-49.06%



# Relatório do Modelo



# Relatório do Modelo

