

Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-11-25
Dia final	2023-12-28
Dias totais	3016

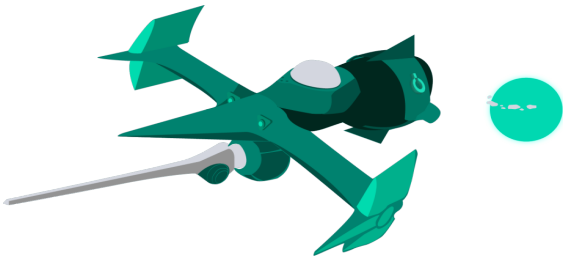


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	278.48%
Retorno acum. CDI	186.09%
Retorno acum. IBOV	142.74%
Retorno a.a. modelo	11.76%
Vol 252d	23.11%
Índice Sharpe	0.1
VAR diário 95%	-2.36%
Turn over carteira	20.55%
Drawdown máximo	-54.49%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	138
% Operações vencedoras	60.14%
% Operações perdedoras	39.86%
Média de ganhos	6.16%
Média de perdas	-6.04%
Expec. matemática por trade	1.3%
Maior sequência de vitória	6
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	53.96%



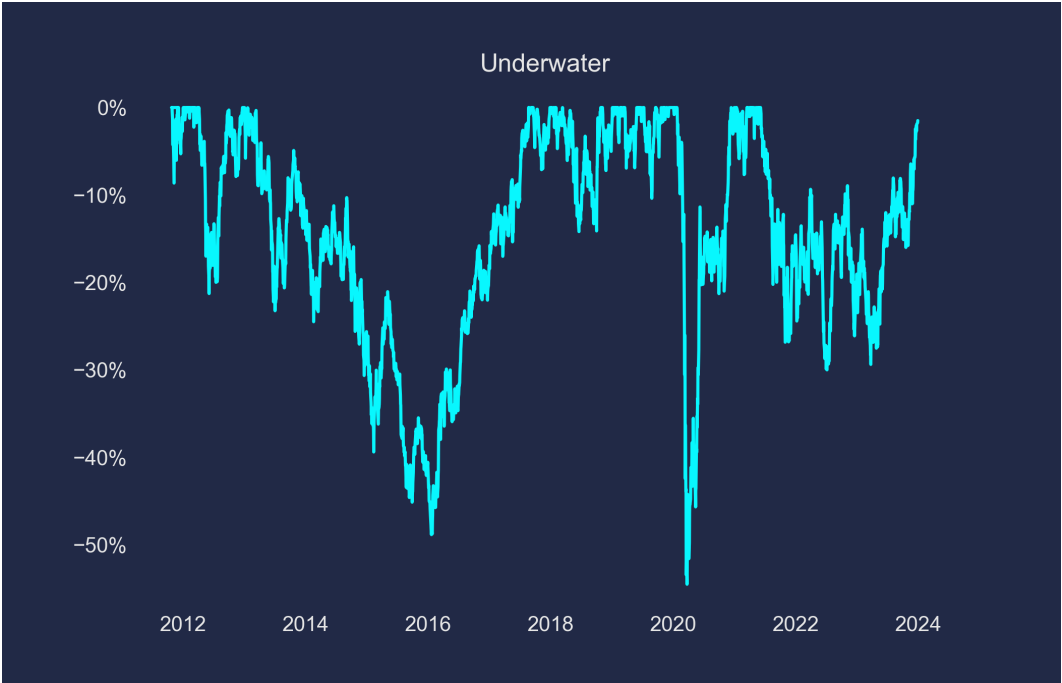
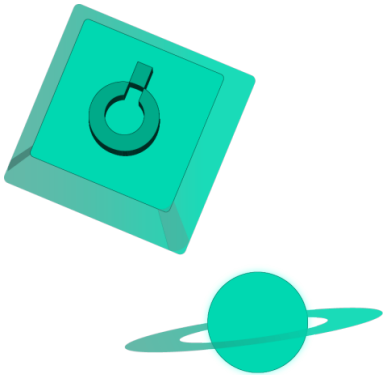
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

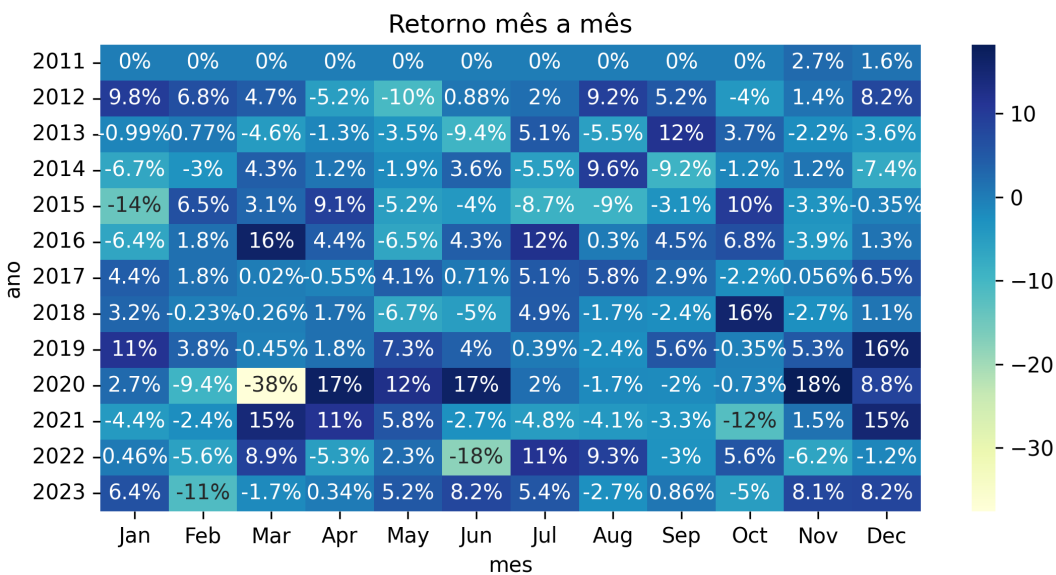
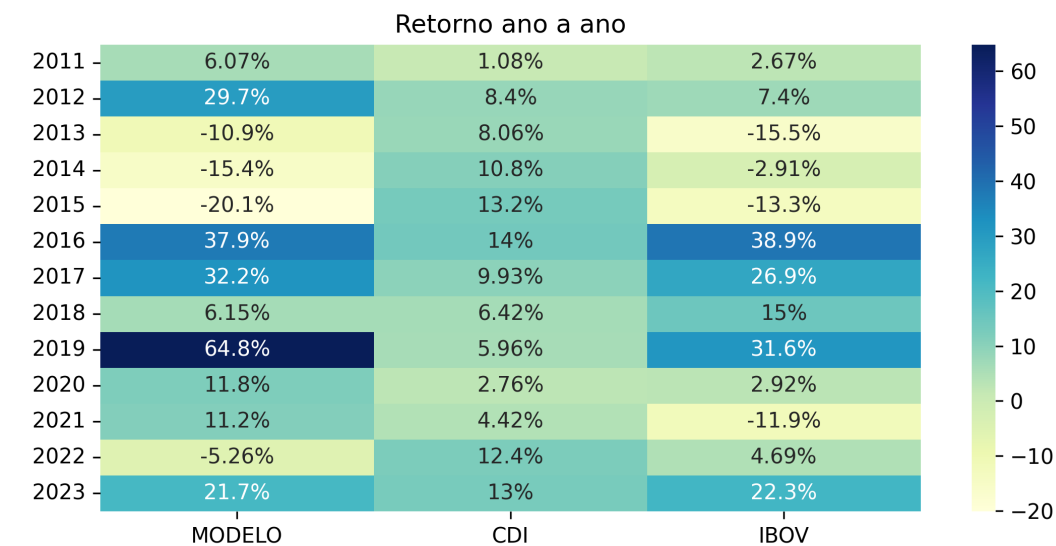
Joesley Day - 18/05/2017	-6.34%
Auge pandemia: Março - 2020	-39.7%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-4.5%
Greve dos caminhoneiros - 2018	-3.29%
Precatórios - ago/nov 2021	-15.14%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-52.62%
Pior período de 3 meses	-48.04%
Pior período de 6 meses	-39.33%
Pior período de 1 ano	-38.0%
Pior período de 2 anos	-41.9%
Pior período de 3 anos	-48.67%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

