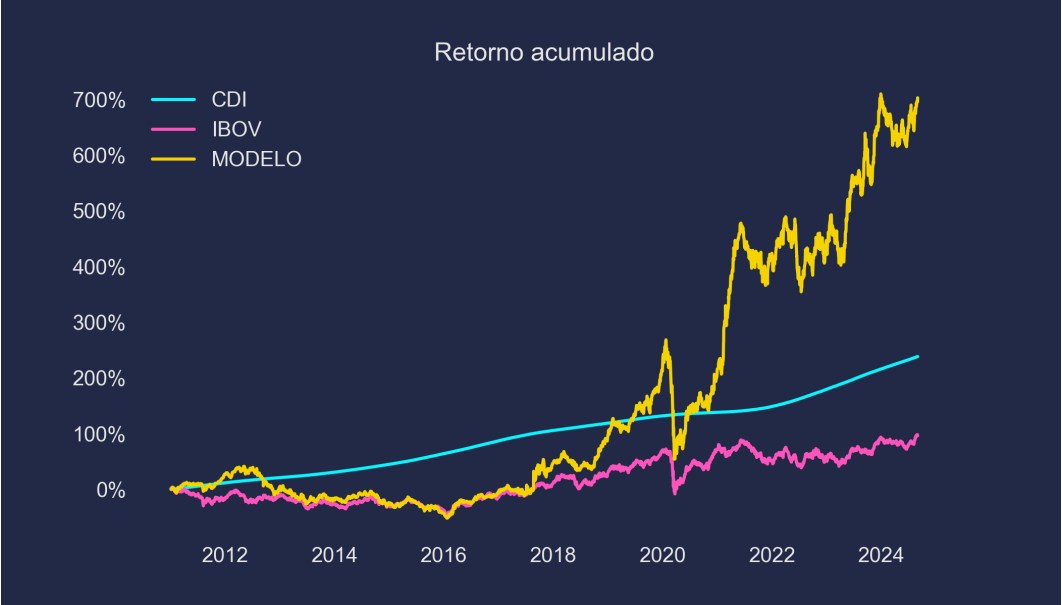


Relatório do Modelo

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

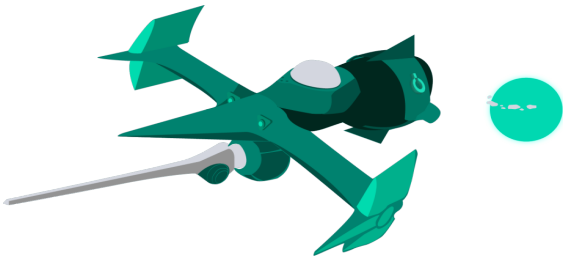


Estatísticas de Retorno e Risco

| | |
|----------------------|---------|
| Retorno acum. modelo | 702.87% |
| Retorno acum. CDI | 238.41% |
| Retorno acum. IBOV | 96.24% |
| Retorno a.a. modelo | 16.76% |
| Vol 252d | 17.13% |
| Índice Sharpe | 0.25 |
| VAR diário 95% | -2.46% |
| Turn over carteira | 22.52% |
| Drawdown máximo | -65.82% |

Estatísticas de Trade

| | |
|-----------------------------|--------|
| Número de carteiras | 152 |
| % Operações vencedoras | 57.24% |
| % Operações perdedoras | 42.76% |
| Média de ganhos | 7.64% |
| Média de perdas | -6.0% |
| Expec. matemática por trade | 1.81% |
| Maior sequência de vitória | 8 |
| Maior sequência de derrotas | 5 |
| % Meses carteira > IBOV | 60.13% |



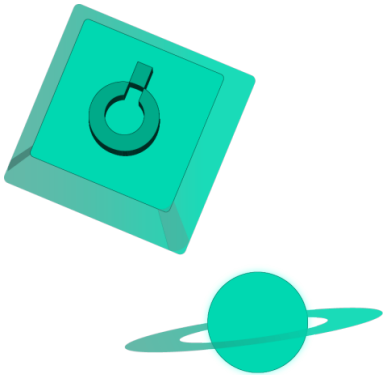
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

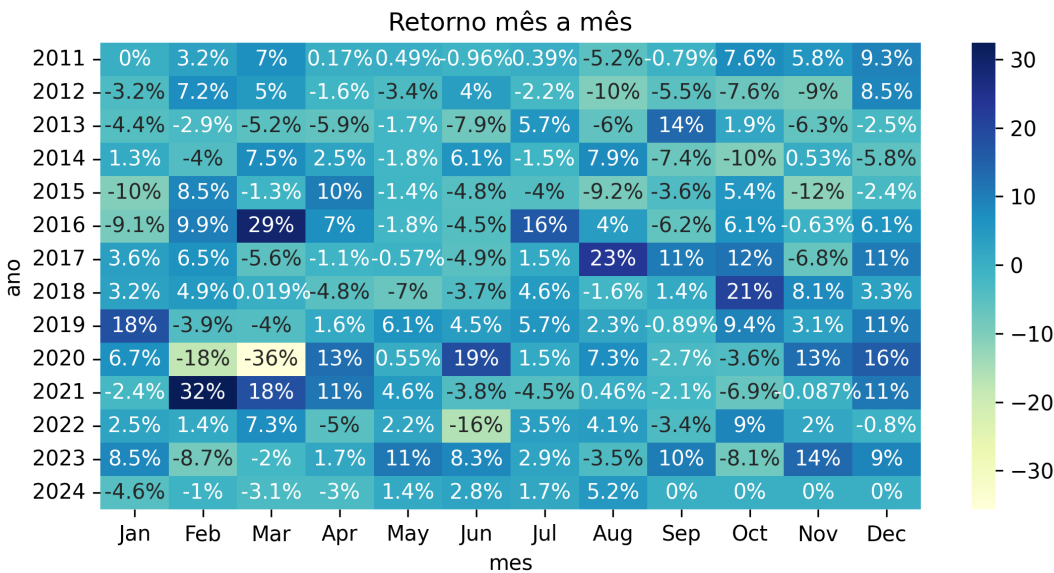
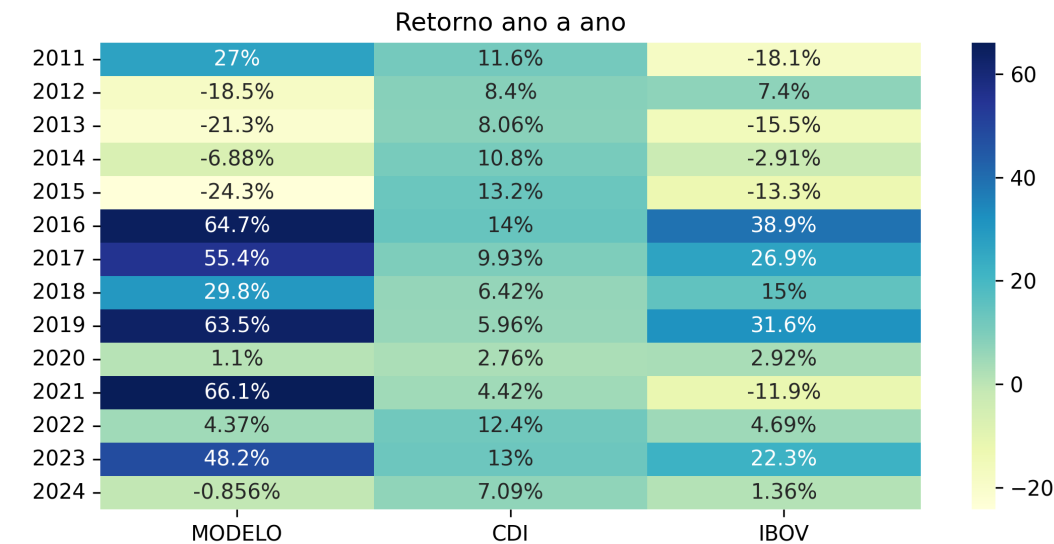
| | |
|--------------------------------|---------|
| Joesley Day - 18/05/2017 | -4.76% |
| Auge pandemia: Março - 2020 | -37.12% |
| Boa sorte Day - 10/11/2022 | -3.25% |
| Greve dos caminhoneiros - 2018 | -9.26% |
| Precatórios - ago/nov 2021 | -7.67% |
| Crise de 2008 | - |

Períodos sem lucro

| | |
|-------------------------|---------|
| Pior período de 1 mês | -54.28% |
| Pior período de 3 meses | -51.47% |
| Pior período de 6 meses | -40.18% |
| Pior período de 1 ano | -45.64% |
| Pior período de 2 anos | -42.84% |
| Pior período de 3 anos | -53.81% |



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

