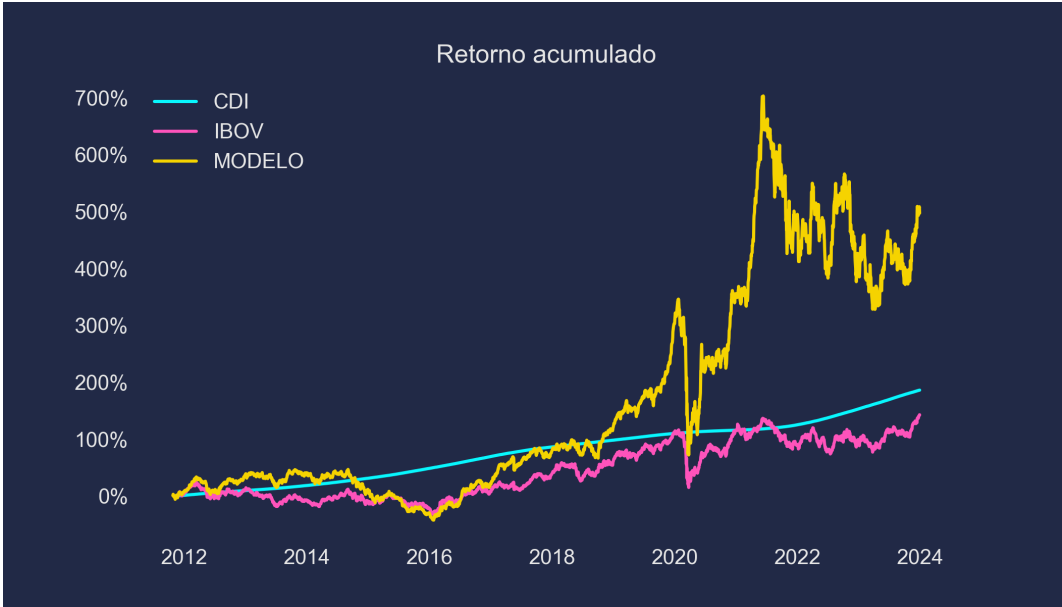


Relatório do Modelo

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

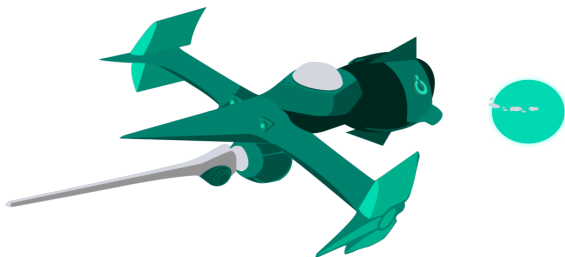


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	497.12%
Retorno acum. CDI	186.09%
Retorno acum. IBOV	142.74%
Retorno a.a. modelo	16.1%
Vol 252d	30.53%
Índice Sharpe	0.24
VAR diário 95%	-2.72%
Turn over carteira	23.48%
Drawdown máximo	-61.4%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	138
% Operações vencedoras	54.35%
% Operações perdedoras	45.65%
Média de ganhos	8.52%
Média de perdas	-6.2%
Expec. matemática por trade	1.8%
Maior sequência de vitória	5
Maior sequência de derrotas	5
% Meses carteira > IBOV	53.96%



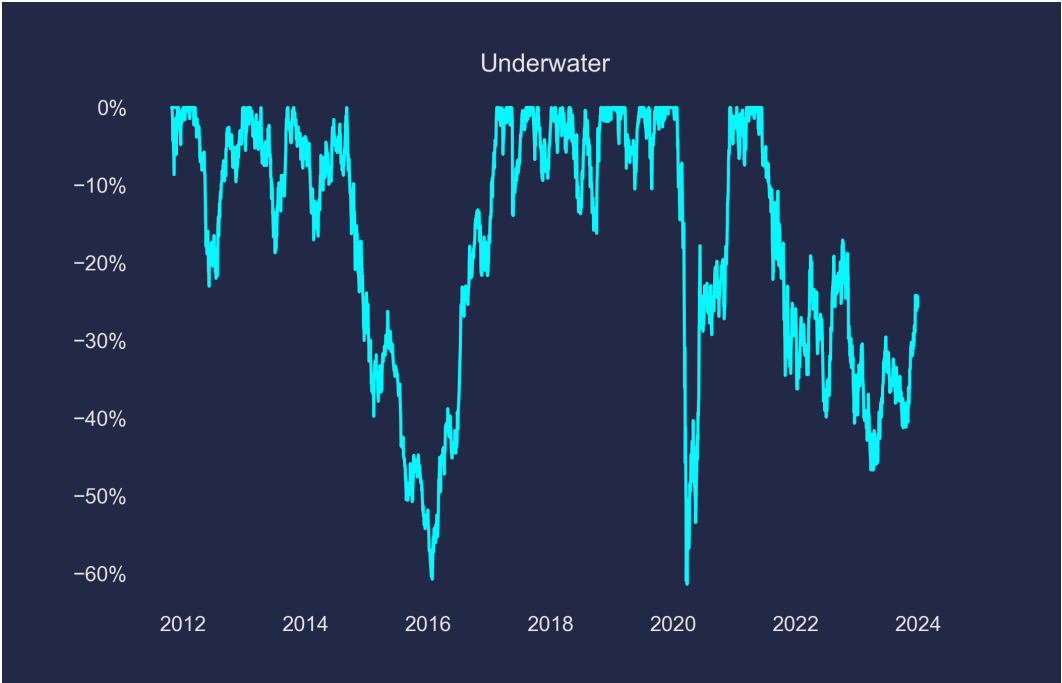
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

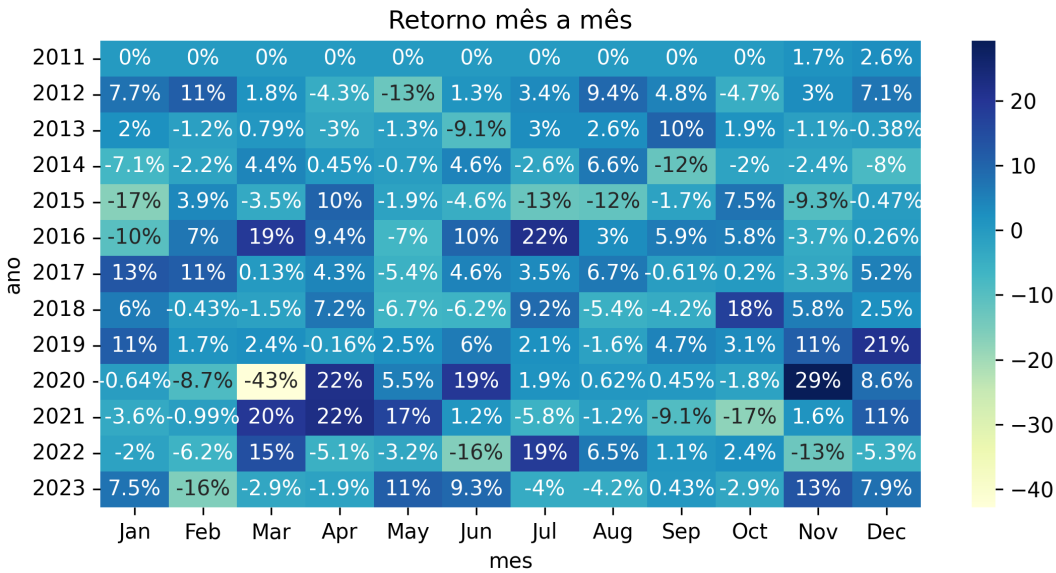
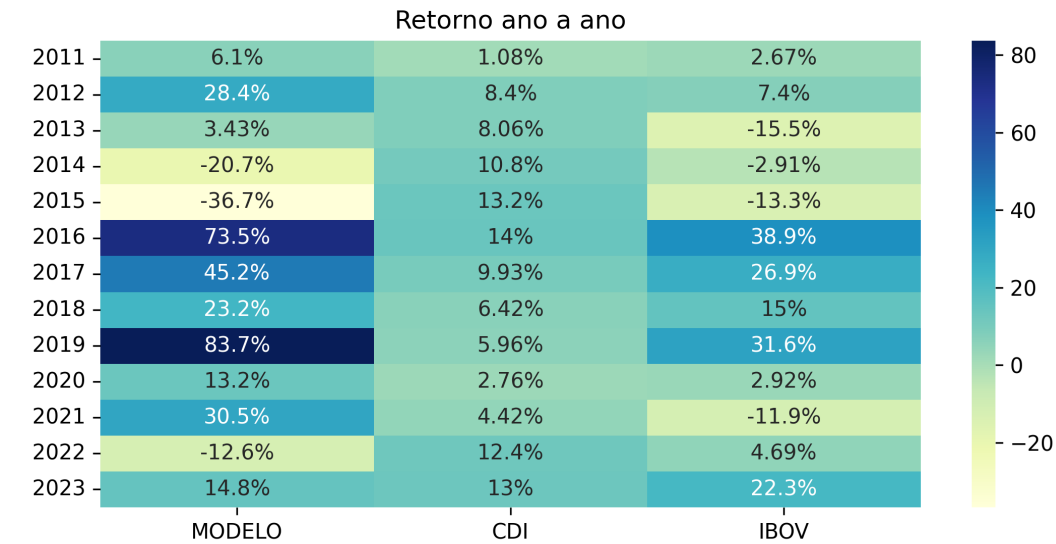
Joesley Day - 18/05/2017	-11.02%
Auge pandemia: Março - 2020	-44.98%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-7.05%
Greve dos caminhoneiros - 2018	1.65%
Precatórios - ago/nov 2021	-22.94%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-58.34%
Pior período de 3 meses	-54.28%
Pior período de 6 meses	-40.39%
Pior período de 1 ano	-49.45%
Pior período de 2 anos	-58.5%
Pior período de 3 anos	-58.61%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

