

ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (dezembro-19/janeiro-20/fevereiro-20)

	% Médio Clientes Ganhadores Por Dia	% Médio Clientes Perdedores Por Dia	Ganho Diário Mediano (R\$)	Perda Diária Mediana (R\$)	% Médio Clientes Ganhadores Por Mês	% Médio Clientes Perdedores Por Mês	Ganho Mensal Mediano (R\$)	Perda Mensal Mediana (R\$)	
Ações do Ibovespa									
ABEV3	62%	38%	20,00	-11,36	59%	41%	15,00	-10,04	
AZUL4	61%	39%	69,45	-57,20	60%	40%	86,00	-69,12	
B3SA3	61%	39%	64,00	-52,00	59%	41%	77,19	-64,17	
BBAS3	55%	45%	78,79	-68,00	54%	46%	80,63	-79,00	
BBDC3	63%	37%	52,00	-36,50	61%	39%	40,56	-27,00	
BBDC4	58%	42%	57,47	-50,00	57%	43%	60,00	-49,28	
BBSE3	60%	40%	35,46	-27,64	57%	43%	37,73	-31,53	
BPAC11	64%	36%	111,21	-82,41	61%	39%	112,50	-86,02	
BRAP4	58%	42%	55,00	-41,00	58%	42%	54,00	-46,69	
BRDT3	68%	32%	54,19	-37,03	64%	36%	64,75	-38,00	
BRFS3	57%	43%	71,84	-60,00	55%	45%	87,75	-66,37	
BRKM5	58%	42%	79,76	-75,00	55%	45%	97,97	-85,25	
BRML3	62%	38%	37,75	-25,04	57%	43%	35,72	-30,64	
BTOW3	58%	42%	118,50	-111,13	57%	43%	171,50	-117,96	
CCRO3	60%	40%	45,46	-33,85	59%	41%	49,44	-37,58	
CIEL3	60%	40%	39,69	-28,02	56%	44%	41,63	-35,85	
CMIG4	60%	40%	39,55	-20,00	57%	43%	39,56	-18,00	
COGN3	61%	39%	50,00	-39,24	60%	40%	69,11	-32,18	
CRFB3	64%	36%	44,00	-32,58	58%	42%	50,83	-39,31	
CSAN3	57%	43%	64,60	-54,58	57%	43%	104,99	-57,92	
CSNA3	58%	42%	77,91	-60,00	55%	45%	78,00	-57,27	
CVCB3	60%	40%	51,68	-42,76	59%	41%	68,66	-44,23	
CYRE3	64%	36%	45,77	-30,73	63%	37%	61,82	-34,30	
ECOR3	62%	38%	35,83	-26,00	60%	40%	37,67	-19,00	
EGIE3	60%	40%	27,50	-25,17	58%	42%	37,28	-22,11	
ELET3	65%	35%	82,94	-61,50	66%	34%	104,24	-61,29	
ELET6	68%	32%	73,60	-52,00	64%	36%	98,57	-53,80	
EMBR3	62%	38%	20,00	-13,25	59%	41%	18,00	-12,21	
ENBR3	61%	39%	12,00	-5,91	57%	43%	7,69	-5,17	
EQTL3	64%	36%	39,00	-31,00	60%	40%	50,82	-30,62	
FLRY3	60%	40%	16,78	-15,61	57%	43%	17,88	-20,00	
GGBR4	59%	41%	63,68	-50,78	58%	42%	59,20	-50,03	
GNDI3	61%	39%	101,57	-81,24	59%	41%	115,64	-76,97	
GOAU4	62%	38%	50,00	-35,33	59%	41%	47,85	-28,08	
GOLL4	59%	41%	95,00	-86,00	57%	43%	110,15	-93,59	
HAPV3	60%	40%	110,11	-82,00	56%	44%	140,76	-94,82	
HGTX3	61%	39%	73,00	-47,00	59%	41%	82,00	-60,00	
HYPE3	59%	41%	40,88	-34,00	55%	45%	57,00	-40,57	
IGTA3	64%	36%	58,50	-43,50	61%	39%	59,18	-45,77	
IRBR3	64%	36%	81,00	-56,06	65%	35%	88,70	-50,67	
ITSA4	60%	40%	15,60	-10,50	56%	44%	11,65	-7,89	
ITUB4	58%	42%	48,72	-41,28	55%	45%	52,43	-40,93	
JBSS3	60%	40%	72,01	-63,29	58%	42%	72,00	-57,00	
KLBN11	62%	38%	29,30	-22,78	59%	41%	37,20	-26,16	
LAME4	61%	39%	38,21	-36,42	62%	38%	50,00	-32,97	
LREN3	64%	36%	57,54	-37,29	58%	42%	63,23	-35,72	
MGLU3	60%	40%	63,00	-60,54	58%	42%	59,21	-54,71	
MRFG3	60%	40%	49,78	-30,74	59%	41%	54,65	-39,00	
MRVE3	62%	38%	38,44	-33,94	62%	38%	41,00	-39,00	
MULT3	62%	38%	50,00	-43,23	62%	38%	49,50	-39,54	
NTCO3	66%	34%	78,69	-53,39	64%	36%	99,66	-60,00	
PCAR4	63%	37%	77,21	-59,56	59%	41%	100,19	-68,67	
PETR3	62%	38%	53,90	-39,00	58%	42%	71,00	-58,00	
PETR4	57%	43%	43,66	-34,92	54%	46%	49,66	-47,84	
QUAL3	65%	35%	75,00	-52,92	65%	35%	116,63	-59,01	
RADL3	59%	41%	103,68	-75,83	55%	45%	102,20	-100,00	
RAIL3	63%	37%	47,62	-31,95	62%	38%	59,00	-35,66	
RENT3	66%	34%	58,98	-40,03	62%	38%	70,00	-43,60	
SANB11	61%	39%	50,02	-46,31	57%	43%	68,00	-75,29	
SBSP3	62%	38%	87,89	-63,00	59%	41%	90,00	-81,55	
SMLS3	58%	42%	49,41	-44,00	60%	40%	45,22	-57,83	
SULA11	64%	36%	82,31	-55,50	61%	39%	100,00	-49,20	
SUZB3	64%	36%	83,50	-59,22	62%	38%	100,00	-60,00	
TAE11	61%	39%	13,80	-12,11	60%	40%	15,00	-6,80	
TIMP3	62%	38%	15,07	-14,61	60%	40%	18,64	-14,66	
TOTS3	64%	36%	119,69	-83,57	65%	35%	127,00	-83,64	
UGPA3	62%	38%	65,20	-50,42	57%	43%	86,49	-65,14	
USIM5	58%	42%	61,16	-52,66	55%	45%	60,00	-60,69	
VALE3	56%	44%	66,65	-52,00	53%	47%	81,33	-83,65	
VIVT4	61%	39%	33,73	-28,27	58%	42%	43,37	-28,00	
VVAR3	58%	42%	41,98	-40,74	56%	44%	45,80	-38,54	
WEGE3	60%	40%	29,75	-25,75	58%	42%	42,76	-28,85	
YDUQ3	62%	38%	70,00	-62,77	60%	40%	91,31	-52,33	
ETF									
BOVA11	55%	45%	20,79	-15,19	53%	47%	31,61	-17,55	
BOVV11	64%	36%	38,58	-8,98	46%	54%	15,41	-8,03	
Futuros	Vencimentos								
WDO	1º vencimento	49%	51%	63,48	-85,64	26%	74%	109,62	-184,14
WIN	1º vencimento	52%	48%	69,00	-95,32	26%	74%	175,80	-266,16
Opções de Compra	Intervalo de Delta (%)								
BBAS3	0 ≤ Δ ≤ 20	51%	49%	53,47	-35,28	49%	51%	47,98	-48,04
BBAS3	20 ≤ Δ ≤ 40	56%	44%	122,39	-134,03	61%	39%	126,00	-80,93
BBAS3	40 ≤ Δ ≤ 60	64%	36%	189,71	-120,00	68%	32%	209,71	-108,67
BBAS3	60 ≤ Δ ≤ 80	72%	28%	113,12	-94,31	69%	31%	228,49	-210,11

BBAS3	80 ≤ Δ ≤ 100	86%	14%	68,61	-82,69	75%	25%	122,31	-177,03
ITUB4	0 ≤ Δ ≤ 20	54%	46%	45,41	-34,74	51%	49%	73,01	-50,07
ITUB4	20 ≤ Δ ≤ 40	60%	40%	119,67	-64,09	57%	43%	119,84	-91,00
ITUB4	40 ≤ Δ ≤ 60	67%	33%	142,92	-85,37	70%	30%	154,91	-82,35
ITUB4	60 ≤ Δ ≤ 80	66%	34%	149,43	-135,00	60%	40%	133,50	-39,04
ITUB4	80 ≤ Δ ≤ 100	59%	41%	239,97	-83,33	62%	38%	178,29	-52,87



ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (dezembro-19/janeiro-20/fevereiro-20)

Opções de Compra	Intervalo de Delta (%)	% Médio Clientes	% Médio Clientes	Ganho Diário	Perda Diária	% Médio Clientes	% Médio Clientes	Ganho Mensal	Perda Mensal
		Ganhadores Por Dia	Perdedores Por Dia	Mediano (R\$)	Mediana (R\$)	Ganhadores Por Mês	Perdedores Por Mês	Mediano (R\$)	Mediana (R\$)
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	47%	53%	132,00	-10,53	42%	58%	119,85	-65,01
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	56%	44%	139,79	-90,14	56%	44%	163,77	-100,00
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	61%	39%	189,43	-149,13	66%	34%	218,31	-144,69
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	66%	34%	199,18	-190,30	68%	32%	300,00	-193,75
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	66%	34%	119,99	-100,61	64%	36%	215,00	-151,34
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	55%	45%	76,77	-48,96	46%	54%	90,00	-120,00
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	59%	41%	144,96	-130,88	59%	41%	189,39	-156,29
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	65%	35%	212,82	-178,78	68%	32%	263,66	-149,92
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	71%	29%	226,85	-249,49	70%	30%	294,13	-183,70
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	69%	31%	241,71	-210,36	64%	36%	376,34	-186,80
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	53%	47%	32,29	-18,00	51%	49%	44,84	-36,54
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	57%	43%	52,24	-40,00	55%	45%	59,76	-40,09
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	62%	38%	70,02	-44,53	66%	34%	99,75	-46,00
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	66%	34%	97,84	-62,78	71%	29%	100,00	-61,64
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	54%	46%	58,93	-54,00	61%	39%	111,91	-78,33
Opções de Venda	Intervalo de Delta (%)								
BBAS3	0 ≤ Δ ≤ 20	58%	42%	34,90	-32,27	50%	50%	50,48	-33,64
BBAS3	20 ≤ Δ ≤ 40	55%	45%	162,43	-92,00	58%	42%	169,79	-97,05
BBAS3	40 ≤ Δ ≤ 60	77%	23%	143,39	-112,96	78%	22%	185,65	-80,24
BBAS3	60 ≤ Δ ≤ 80	68%	32%	94,83	-48,60	66%	34%	99,63	-48,60
BBAS3	80 ≤ Δ ≤ 100	61%	39%	40,32	-41,25	69%	31%	44,70	-83,20
ITUB4	0 ≤ Δ ≤ 20	55%	45%	39,96	-31,07	50%	50%	32,97	-34,57
ITUB4	20 ≤ Δ ≤ 40	64%	36%	69,93	-65,15	63%	37%	74,87	-54,02
ITUB4	40 ≤ Δ ≤ 60	69%	31%	139,47	-108,14	71%	29%	119,49	-155,00
ITUB4	60 ≤ Δ ≤ 80	77%	23%	97,39	-50,68	78%	22%	97,39	-105,12
ITUB4	80 ≤ Δ ≤ 100	62%	38%	10,81	-19,33	67%	33%	110,60	-31,04
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	47%	53%	92,84	-20,02	44%	56%	99,66	-60,00
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	57%	43%	122,63	-94,22	54%	46%	154,68	-110,59
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	61%	39%	131,56	-99,38	65%	35%	148,95	-144,89
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	62%	38%	170,32	-144,10	68%	32%	246,93	-120,63
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	62%	38%	135,77	-46,13	61%	39%	198,02	-65,42
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	53%	47%	79,82	-55,01	49%	51%	100,00	-120,00
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	60%	40%	159,62	-150,55	61%	39%	198,00	-183,00
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	65%	35%	180,85	-186,57	68%	32%	240,50	-180,00
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	69%	31%	270,00	-293,32	72%	28%	299,18	-266,02
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	64%	36%	291,87	-276,29	74%	26%	198,75	-155,00
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	60%	40%	30,81	-20,07	46%	54%	39,91	-50,03
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	52%	48%	34,58	-38,00	53%	47%	40,00	-62,48
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	58%	42%	41,07	-80,51	58%	42%	56,91	-60,07
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	66%	34%	87,48	-50,10	75%	25%	147,00	-34,08
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	23%	77%	210,50	-191,00	35%	65%	210,50	-178,52

	MÉTRICAS DE RISCO		
	VaR 1d (99,96%)	Estresse Estatístico (99,96%)	Estresse Estatístico (0,04%)
Ações do Ibovespa			
ABEV3	8,2%	11,1%	-9,7%
AZUL4	13,6%	14,0%	-13,7%
B3SA3	10,1%	20,2%	-16,5%
BBAS3	8,3%	17,1%	-13,5%
BBDC3	8,0%	13,1%	-11,0%
BBDC4	6,3%	12,8%	-10,6%
BBSE3	5,5%	9,8%	-8,6%
BPAC11	9,6%	19,6%	-14,7%
BRAP4	10,4%	17,5%	-14,6%
BRDT3	7,6%	14,7%	-11,6%
BRFS3	7,6%	15,3%	-12,5%
BRKM5	10,7%	18,4%	-14,0%
BRML3	7,5%	20,1%	-14,8%
BTOW3	12,2%	24,3%	-17,9%
CCRO3	10,0%	17,0%	-13,9%
CIEL3	9,6%	12,8%	-11,1%
CMIG4	8,3%	15,0%	-12,7%
COGN3	9,6%	17,0%	-14,2%
CRFB3	8,6%	7,5%	-6,9%
CSAN3	8,1%	18,2%	-15,7%
CSNA3	12,2%	21,0%	-16,2%
CVCB3	12,4%	13,6%	-10,8%
CYRE3	10,0%	28,4%	-20,5%
ECOR3	8,3%	12,2%	-10,4%
EGIE3	6,3%	18,4%	-14,6%
ELET3	11,0%	21,1%	-15,8%
ELET6	8,6%	18,4%	-14,2%
EMBR3	8,8%	15,4%	-12,9%
ENBR3	6,3%	31,4%	-23,0%
EQLT3	7,5%	11,7%	-10,3%
FLRY3	8,0%	10,8%	-9,0%
GGBR4	11,7%	15,4%	-12,6%
GNDI3	9,7%	8,8%	-7,4%
GOAU4	13,9%	18,0%	-15,0%
GOLL4	15,8%	30,1%	-19,5%
HAPV3	9,1%	9,1%	-8,2%
HGTX3	9,4%	38,1%	-25,3%
HYPE3	6,3%	16,6%	-13,3%
IGTA3	7,7%	12,8%	-10,7%
IRBR3	16,0%	15,4%	-11,2%
ITSA4	6,0%	13,8%	-11,2%
ITUB4	6,1%	14,2%	-11,5%
JBSS3	10,8%	23,2%	-17,6%
KLBN11	9,4%	15,1%	-12,3%
LAME4	10,1%	16,8%	-13,0%
LREN3	7,8%	17,0%	-13,0%
MGLU3	9,6%	29,5%	-20,0%
MRFG3	14,1%	23,2%	-16,9%
MRVE3	11,1%	21,5%	-17,4%
MULT3	7,4%	15,6%	-12,8%
NTCO3	8,4%	13,3%	-10,5%
PCAR4	9,7%	12,5%	-10,8%
PETR3	9,9%	18,4%	-15,7%
PETR4	9,7%	17,8%	-15,9%
QUAL3	11,1%	18,7%	-15,3%
RADL3	8,3%	27,1%	-18,0%
RAIL3	9,2%	25,4%	-20,3%
RENT3	7,5%	17,8%	-13,7%
SANB11	7,1%	10,9%	-9,6%
SBSP3	8,1%	13,7%	-12,3%
SMLS3	8,6%	21,8%	-18,7%
SULA11	8,7%	12,4%	-10,6%
SUZB3	9,0%	14,4%	-11,6%
TAEF11	4,7%	17,8%	-14,3%
TIMP3	5,9%	20,7%	-16,3%
TOTS3	10,4%	12,4%	-10,2%
UGPA3	10,7%	12,7%	-10,7%
USIM5	13,2%	21,6%	-16,5%
VALE3	10,5%	17,1%	-14,6%
VIVT4	5,3%	9,4%	-8,3%
VVAR3	13,9%	21,8%	-16,0%
WEGE3	12,3%	20,3%	-15,5%
YDUQ3	0,1%	22,2%	-17,8%
ETFs			
BOVA11	6,9%	8,3%	-7,8%
BOVV11	6,9%	6,7%	-7,2%
Spots			
USD/BRL	2,0%	7,7%	-6,3%
Ibovespa	6,9%	9,7%	-9,7%
ETTJ (bps)			
Pré 1 ano	11,30	32,44	-27,52
Pré 3 anos	21,08	45,40	-36,15
Pré 5 anos	21,01	67,64	-55,17
Cupom de IPCA 1 ano	114,70	26,94	-20,66
Cupom de IPCA 5 anos	15,19	33,31	-26,50
Cupom de IPCA 10 anos	13,79	62,49	-50,10
Cupom de IPCA 15,5 anos	12,67	72,39	-59,14