

ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (junho/julho/agosto) - 2020

		% 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		63%	37%	19,96	-15,13	60%	40%	20,00	-16,16
AZUL4		59%	41%	62,06	-63,21	57%	43%	67,86	-71,67
B3SA3		61%	39%	62,03	-57,87	57%	43%	63,00	-60,00
BBAS3		59%	41%	59,77	-51,81	58%	42%	69,00	-54,34
BBDC3		65%	35%	30,83	-23,04	64%	36%	29,00	-16,06
BBDC4		60%	40%	54,14	-44,19	58%	42%	54,60	-45,00
BBSE3		61%	39%	27,94	-29,42	55%	45%	33,48	-35,77
BEEF3		61%	39%	43,47	-30,86	55%	45%	46,48	-55,61
BPAC11		62%	38%	137,74	-106,06	60%	40%	177,43	-120,00
BRAP4		54%	46%	40,74	-34,44	51%	49%	49,28	-49,20
BRDT3		66%	34%	48,43	-44,74	62%	38%	63,00	-39,31
BRFS3		61%	39%	62,28	-45,00	60%	40%	72,00	-51,39
BRKM5		60%	40%	54,93	-49,53	56%	44%	63,71	-65,33
BRML3		60%	40%	34,23	-29,29	59%	41%	46,68	-35,00
BTOW3		60%	40%	131,46	-135,08	59%	41%	151,00	-150,38
CCRO3		60%	40%	39,20	-33,07	57%	43%	38,01	-28,18
CIEL3		58%	42%	31,86	-27,63	57%	43%	40,00	-31,17
CMIG4		61%	39%	25,39	-19,79	59%	41%	27,62	-21,15
COGN3		58%	42%	59,23	-50,92	56%	44%	68,00	-64,00
CPFE3		63%	37%	33,85	-34,60	61%	39%	38,85	-43,31
CRFB3		63%	37%	30,87	-28,83	57%	43%	36,74	-38,00
CSAN3		58%	42%	83,50	-65,63	59%	41%	107,74	-65,54
CSNA3		57%	43%	45,33	-38,13	56%	44%	49,16	-47,02
CVCB3		61%	39%	41,08	-48,06	60%	40%	50,00	-50,38
CYRE3		60%	40%	49,32	-42,83	59%	41%	57,74	-46,92
ECOR3		62%	38%	39,61	-39,78	58%	42%	36,00	-40,00
EGIE3		63%	37%	27,00	-24,59	57%	43%	29,08	-24,52
ELET3		61%	39%	77,86	-74,84	61%	39%	95,90	-77,17
ELET6		60%	40%	76,91	-63,92	59%	41%	89,90	-65,60
EMBR3		61%	39%	29,72	-22,79	60%	40%	35,89	-28,00
ENBR3		62%	38%	16,22	-16,38	56%	44%	15,00	-17,00
ENGI1		65%	35%	78,59	-52,64	59%	41%	79,71	-58,50
EQTL3		60%	40%	37,51	-27,44	57%	43%	45,00	-32,14
FLRY3		61%	39%	21,27	-19,34	57%	43%	24,92	-29,00
GGBR4		58%	42%	44,28	-40,56	58%	42%	46,00	-42,64
GNDI3		62%	38%	74,95	-66,33	56%	44%	92,24	-77,00
GOAU4		60%	40%	31,04	-20,32	57%	43%	30,00	-21,43
GOLL4		60%	40%	56,75	-61,11	59%	41%	59,66	-67,16
HAPV3		61%	39%	80,39	-73,67	55%	45%	81,80	-75,39
HGTX3		61%	39%	40,41	-40,00	60%	40%	56,15	-51,04
HYPE3		61%	39%	40,10	-36,61	57%	43%	49,00	-52,40
IGTA3		61%	39%	60,90	-51,17	59%	41%	65,00	-53,32
IRBR3		55%	45%	56,94	-53,01	54%	46%	61,00	-61,00
ITSA4		62%	38%	12,00	-8,27	58%	42%	10,33	-8,00
ITUB4		61%	39%	43,66	-33,38	57%	43%	48,33	-44,00
JBSS3		62%	38%	60,31	-44,31	60%	40%	59,42	-47,86
KLBN11		61%	39%	36,78	-31,30	55%	45%	41,00	-38,26
LAME4		60%	40%	50,39	-41,11	58%	42%	56,85	-50,09
LREN3		61%	39%	60,06	-49,33	60%	40%	78,00	-56,00
MGLU3		59%	41%	66,94	-69,51	58%	42%	72,96	-82,50
MRFG3		61%	39%	51,00	-40,99	59%	41%	59,23	-51,00
MRVE3		59%	41%	31,04	-29,86	56%	44%	39,88	-44,12
MULT3		58%	42%	44,93	-52,14	59%	41%	64,65	-47,58
NTCO3		65%	35%	79,60	-60,38	63%	37%	91,92	-75,65
PCAR3		64%	36%	77,58	-73,55	60%	40%	104,00	-106,33
PETR3		65%	35%	48,73	-29,11	64%	36%	46,94	-25,77
PETR4		60%	40%	37,25	-32,07	58%	42%	37,86	-34,00
QUAL3		60%	40%	46,74	-42,18	59%	41%	60,00	-52,85
RADL3		65%	35%	75,35	-63,35	59%	41%	102,46	-68,46
RAIL3		63%	37%	51,87	-40,56	60%	40%	54,36	-40,73
RENT3		61%	39%	74,57	-61,71	58%	42%	86,29	-69,04
SANB11		63%	37%	49,01	-46,30	59%	41%	54,34	-46,92
SBSP3		61%	39%	83,86	-81,57	59%	41%	108,43	-96,00
SULA11		60%	40%	63,77	-61,98	53%	47%	74,68	-83,22
SUZB3		63%	37%	77,70	-58,68	60%	40%	98,36	-70,50
TAAE11		62%	38%	21,71	-12,94	53%	47%	16,81	-14,19
TIMP3		60%	40%	18,46	-16,74	56%	44%	22,68	-19,00
TOTS3		62%	38%	37,92	-27,23	60%	40%	40,80	-30,36
UGPA3		64%	36%	54,73	-46,16	61%	39%	62,00	-49,00
USIM5		59%	41%	44,50	-32,05	56%	44%	48,00	-39,66
VALE3		57%	43%	57,96	-51,18	54%	46%	59,37	-60,00
VIVT4		61%	39%	35,64	-33,16	59%	41%	37,01	-33,00
VVAR3		60%	40%	68,83	-64,68	60%	40%	71,75	-70,45
WEGE3		60%	40%	46,28	-41,57	58%	42%	52,57	-52,00
YDUQ3		63%	37%	69,79	-61,74	58%	42%	88,73	-79,00
ETF									
BOVA11		57%	43%	32,40	-37,13	51%	49%	37,06	-42,69
BOVV11		58%	42%	51,20	-58,76	53%	47%	32,97	-33,63
Futuros									
	Vencimentos								
WDO	1º vencimento	50%	50%	100,00	-143,20	23%	77%	150,60	-315,00
WIN	1º vencimento	52%	48%	67,46	-93,56	27%	73%	144,62	-236,00
Opções de Compra									
	Intervalo de Delta (%)								
BBDC4	0 ≤ Δ ≤ 20	52%	48%	38,36	-15,10	47%	53%	48,63	-24,05
BBDC4	20 ≤ Δ ≤ 40	57%	43%	74,84	-50,00	55%	45%	99,82	-56,74
BBDC4	40 ≤ Δ ≤ 60	60%	40%	127,39	-70,19	61%	39%	114,19	-80,50
BBDC4	60 ≤ Δ ≤ 80	59%	41%	134,17	-72,35	65%	35%	126,90	-80,67
BBDC4	80 ≤ Δ ≤ 100	51%	49%	99,77	-47,49	49%	51%	100,00	-34,05
COGN3	0 ≤ Δ ≤ 20	56%	44%	71,23	-7,36	45%	55%	102,37	-30,00
COGN3	20 ≤ Δ ≤ 40	54%	46%	79,33	-39,50	52%	48%	139,15	-65,02
COGN3	40 ≤ Δ ≤ 60	56%	44%	95,78	-55,91	58%	42%	108,65	-62,57
COGN3	60 ≤ Δ ≤ 80	62%	38%	99,89	-63,72	63%	37%	133,38	-70,21
COGN3	80 ≤ Δ ≤ 100	54%	46%	83,95	-50,13	51%	49%	109,88	-48,85


ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA
Trimestre (junho/julho/agosto) - 2020

Opções de Compra	Intervalo de Delta (%)	% Médio Clientes	% Médio Clientes	Ganho	Perda	% Médio Clientes	% Médio Clientes	Ganho	Perda
		Ganhadores Por Dia	Perdedores Por Dia	Diário Mediano (R\$)	Diária Mediana (R\$)	Ganhadores Por Mês	Perdedores Por Mês	Mensal Mediano (R\$)	Mensal Mediana (R\$)
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	45%	55%	48,24	-3,49	41%	59%	83,53	-32,11
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	60%	40%	100,00	-56,96	60%	40%	149,17	-64,00
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	65%	35%	118,18	-88,60	69%	31%	171,92	-80,00
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	66%	34%	175,68	-139,92	68%	32%	199,77	-117,71
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	64%	36%	115,00	-71,58	62%	38%	218,47	-95,42
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	52%	48%	59,80	-48,53	45%	55%	88,91	-54,03
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	59%	41%	119,92	-111,87	58%	42%	149,70	-100,29
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	66%	34%	176,11	-136,52	68%	32%	240,00	-112,66
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	71%	29%	177,00	-178,21	66%	34%	249,27	-148,97
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	60%	40%	134,47	-100,38	66%	34%	252,86	-194,70
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	54%	46%	53,84	-27,63	51%	49%	67,23	-40,06
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	59%	41%	80,25	-52,35	58%	42%	105,00	-65,00
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	62%	38%	110,03	-90,06	65%	35%	150,00	-85,00
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	61%	39%	134,47	-93,03	67%	33%	155,89	-87,22
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	59%	41%	110,91	-58,40	58%	42%	140,55	-70,94
Opções de Venda	Intervalo de Delta (%)								
BBDC4	0 ≤ Δ ≤ 20	40%	60%	33,48	-11,26	39%	61%	46,00	-15,01
BBDC4	20 ≤ Δ ≤ 40	58%	42%	66,05	-60,57	58%	42%	60,00	-56,85
BBDC4	40 ≤ Δ ≤ 60	64%	36%	95,50	-47,95	65%	35%	119,42	-52,32
BBDC4	60 ≤ Δ ≤ 80	70%	30%	216,45	-60,21	73%	27%	106,96	-36,48
BBDC4	80 ≤ Δ ≤ 100	56%	44%	174,73	-103,15	61%	39%	94,56	-330,62
COGN3	0 ≤ Δ ≤ 20	47%	53%	26,32	-16,01	43%	57%	24,99	-20,05
COGN3	20 ≤ Δ ≤ 40	47%	53%	34,57	-27,07	47%	53%	35,97	-28,00
COGN3	40 ≤ Δ ≤ 60	52%	48%	60,00	-40,00	55%	45%	81,88	-45,85
COGN3	60 ≤ Δ ≤ 80	55%	45%	59,88	-43,00	64%	36%	101,96	-40,02
COGN3	80 ≤ Δ ≤ 100	50%	50%	35,61	-39,91	55%	45%	97,18	-155,00
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	52%	48%	50,14	-15,01	46%	54%	90,00	-30,11
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	61%	39%	104,80	-70,09	62%	38%	119,63	-69,09
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	65%	35%	129,32	-80,33	69%	31%	169,87	-90,88
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	65%	35%	190,88	-120,47	76%	24%	250,00	-100,00
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	61%	39%	88,10	-54,46	59%	41%	184,62	-30,19
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	57%	43%	87,54	-55,05	51%	49%	109,43	-101,71
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	63%	37%	149,35	-112,00	64%	36%	195,33	-137,00
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	70%	30%	189,39	-138,68	73%	27%	267,07	-120,34
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	71%	29%	299,13	-211,97	81%	19%	362,50	-186,00
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	74%	26%	139,14	-403,31	77%	23%	187,50	-254,30
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	54%	46%	32,06	-24,02	47%	53%	49,91	-38,00
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	50%	50%	55,86	-59,27	52%	48%	85,89	-54,03
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	56%	44%	80,42	-70,06	62%	38%	119,47	-82,22
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	55%	45%	99,15	-55,50	60%	40%	120,00	-80,41
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	58%	42%	98,39	-69,21	58%	42%	75,19	-37,00

MÉTRICAS DE RISCO

	VaR 1d (99,96%)	Estresse Estatístico (99,96%)	Estresse Estatístico (0,04%)
Ações do Ibovespa			
ABEV3	6,4%	12,2%	-10,5%
AZUL4	12,0%	43,9%	-34,4%
B3SA3	8,6%	21,8%	-17,4%
BBAS3	6,8%	18,9%	-14,8%
BBDC3	7,4%	14,6%	-12,3%
BBDC4	7,0%	14,4%	-11,9%
BBSE3	6,8%	11,8%	-10,6%
BEEF3	6,3%	20,5%	-15,2%
BPAC11	9,6%	27,8%	-19,5%
BRAP4	6,7%	18,4%	-15,3%
BRDT3	8,7%	26,0%	-18,7%
BRFS3	8,0%	17,6%	-14,2%
BRKM5	9,7%	23,6%	-17,3%
BRML3	11,7%	23,0%	-17,0%
BTOW3	10,1%	26,7%	-19,0%
CCRO3	7,2%	19,3%	-15,5%
CIEL3	11,5%	18,2%	-15,3%
CMIG4	8,5%	16,1%	-13,7%
COGN3	12,6%	22,3%	-18,2%
CPFE3	6,0%	15,3%	-12,6%
CRFB3	6,7%	11,7%	-9,8%
CSAN3	7,8%	19,3%	-16,5%
CSNA3	9,7%	23,3%	-17,5%
CVCB3	12,2%	35,5%	-23,9%
CYRE3	11,0%	30,9%	-21,9%
ECOR3	10,1%	17,7%	-14,3%
EGIE3	4,5%	18,6%	-14,7%
ELET3	14,4%	23,6%	-17,2%
ELET6	12,0%	20,3%	-15,5%
EMBR3	10,5%	18,7%	-15,6%
ENBR3	7,3%	31,5%	-23,1%
ENGI11	7,5%	21,6%	-16,2%
EQTL3	6,4%	12,9%	-11,3%
FLRY3	5,3%	12,8%	-10,6%
GGBR4	8,9%	17,2%	-13,8%
GNDI3	7,9%	28,0%	-20,5%
GOAU4	8,3%	19,7%	-16,2%
GOLL4	13,5%	37,1%	-22,8%
HAPV3	5,7%	23,3%	-18,9%
HGTX3	14,0%	39,2%	-26,1%
HYPE3	8,5%	18,6%	-14,7%
IGTA3	8,3%	16,3%	-13,4%
IRBR3	14,6%	39,5%	-30,5%
ITSA4	6,5%	14,2%	-11,7%
ITUB4	7,1%	14,7%	-12,0%
JBSS3	7,0%	24,7%	-18,5%
KLBN11	6,9%	16,1%	-13,0%
LAME4	7,1%	18,7%	-14,4%
LREN3	8,1%	19,2%	-14,5%
MGLU3	9,3%	32,8%	-21,6%
MRFG3	8,4%	26,6%	-18,7%
MRVE3	8,9%	23,5%	-18,6%
MULT3	9,8%	19,3%	-15,4%
NTCO3	8,4%	16,9%	-12,9%
PCAR3	7,0%	13,1%	-11,3%
PETR3	7,3%	21,3%	-17,7%
PETR4	6,9%	20,2%	-17,7%
QUAL3	10,1%	20,9%	-17,0%
RADL3	5,8%	27,2%	-18,3%
RAIL3	9,2%	26,6%	-21,0%
RENT3	8,4%	21,7%	-16,4%
SANB11	7,2%	13,3%	-11,7%
SBSP3	8,7%	15,4%	-13,6%
SULA11	7,3%	15,0%	-12,4%
SUZB3	7,8%	15,8%	-12,6%
TAAE11	3,0%	17,8%	-14,2%
TIMP3	7,3%	21,1%	-16,6%
TOTS3	8,4%	15,2%	-12,4%
UGPA3	8,9%	16,9%	-13,8%
USIM5	8,9%	23,5%	-17,6%
VALE3	6,4%	18,4%	-15,4%
VIVT4	6,1%	9,9%	-8,7%
VVAR3	10,9%	33,1%	-22,4%
WEGE3	8,7%	21,7%	-16,4%
YDUQ3	0,00%	22,8%	-18,1%
ETFs			
BOVA11	4,9%	10,8%	-10,1%
BOVV11	4,9%	14,2%	-14,4%
Spots			
USD/BRL	4,0%	7,9%	-6,4%
Ibovespa	4,8%	11,1%	-11,0%
ETTJ (bps)			
Pré 1 ano	22,64	28,32	-24,56
Pré 3 anos	35,13	65,74	-50,62
Pré 5 anos	42,21	86,01	-68,18
Cupom de IPCA 1 ano			
Cupom de IPCA 1 ano	23,91	79,09	-75,39
Cupom de IPCA 5 anos			
Cupom de IPCA 5 anos	22,48	106,54	-96,85
Cupom de IPCA 10 anos			
Cupom de IPCA 10 anos	19,76	135,71	-130,98
Cupom de IPCA 15,5 anos			
Cupom de IPCA 15,5 anos	18,55	128,01	-126,38