

ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (outubro/novembro/dezembro) - 2019

Ações do Ibovespa	% Médio Clientes Ganhadores Por Dia	% Médio Clientes Perdedores Por Dia	Ganho Diário Mediano (R\$)	Perda Diário Mediana (R\$)	% Médio Clientes Ganhadores Por Mês	% Médio Clientes Perdedores Por Mês	Ganho Mensal Mediano (R\$)	Perda Mensal Mediana (R\$)	
	ADEV3	61%	39%	15,0	-11,2	59%	41%	14,9	-10,0
AZUL4	62%	38%	64,9	-59,2	61%	39%	86,0	-58,7	
B3SA3	62%	38%	58,8	-47,8	59%	41%	72,0	-58,8	
BBA33	59%	41%	76,5	-63,5	57%	43%	84,8	-71,5	
BBDC3	65%	35%	46,4	-34,4	62%	38%	40,6	-22,8	
BBDC4	61%	39%	60,0	-47,1	59%	41%	60,0	-49,8	
BBSE3	60%	40%	28,9	-22,3	56%	44%	33,5	-29,7	
BPAC11	61%	39%	98,0	-73,3	61%	39%	122,9	-84,1	
BRAP4	57%	43%	59,6	-42,8	53%	47%	67,0	-47,3	
BRDT3	68%	32%	67,0	-27,2	63%	37%	88,9	-30,3	
BRFS3	57%	43%	75,3	-66,3	54%	46%	79,0	-76,9	
BRKM5	61%	39%	67,6	-66,7	58%	42%	90,7	-78,2	
BRML3	61%	39%	29,9	-16,2	55%	45%	24,9	-14,6	
BTOW3	58%	42%	100,0	-95,0	56%	44%	120,3	-112,5	
CCRO3	62%	38%	55,2	-30,6	61%	39%	64,9	-33,6	
CIEL3	60%	40%	38,5	-30,3	57%	43%	39,4	-33,0	
CMIG4	64%	36%	42,8	-20,1	61%	39%	48,0	-21,1	
COGN3	65%	35%	47,1	-37,5	61%	39%	60,0	-30,0	
CSAN3	58%	42%	59,1	-52,5	55%	45%	76,5	-64,1	
CSNA3	60%	40%	69,0	-55,5	56%	44%	68,6	-60,2	
CVCB3	61%	39%	59,0	-51,5	58%	42%	72,2	-50,4	
CYRE3	64%	36%	35,2	-28,0	59%	41%	39,0	-27,9	
ECOR3	65%	35%	33,0	-25,5	63%	37%	37,7	-21,3	
EGIE3	64%	36%	23,2	-18,2	61%	39%	29,0	-22,1	
ELET3	60%	40%	87,0	-81,7	56%	44%	114,0	-95,0	
ELET6	66%	34%	75,7	-68,8	60%	40%	96,7	-87,5	
EMBR3	63%	37%	20,0	-13,3	59%	41%	23,0	-12,6	
ENBR3	62%	38%	11,6	-7,1	57%	43%	10,0	-8,0	
EQTL3	64%	36%	47,1	-50,2	58%	42%	89,6	-41,4	
FLRY3	61%	39%	13,5	-12,0	56%	44%	17,0	-16,2	
GGBR4	60%	40%	58,6	-42,4	58%	42%	52,0	-40,0	
GNDI3	59%	41%	70,0	-60,9	53%	47%	94,6	-77,0	
GOAU4	62%	38%	43,9	-24,9	60%	40%	39,0	-20,1	
GOLL4	57%	43%	91,4	-78,0	55%	45%	104,1	-90,0	
HYPE3	63%	37%	32,2	-26,8	56%	44%	34,7	-34,3	
IGTA3	66%	34%	45,1	-28,0	63%	37%	51,0	-28,0	
IRBR3	67%	33%	62,3	-35,6	65%	35%	75,7	-38,3	
ITSA4	61%	39%	13,8	-9,3	56%	44%	9,4	-7,8	
ITUB4	61%	39%	45,7	-40,0	59%	41%	53,1	-40,9	
JBSS3	57%	43%	69,1	-65,1	55%	45%	70,0	-62,9	
KLBN11	60%	40%	21,5	-16,0	55%	45%	18,9	-18,0	
LAME4	61%	39%	31,5	-32,0	59%	41%	33,8	-33,0	
LEN3	66%	34%	62,9	-35,2	61%	39%	68,4	-38,8	
MGLU3	59%	41%	56,6	-59,0	58%	42%	61,3	-59,0	
MRFG3	58%	42%	32,8	-29,1	55%	45%	43,0	-37,4	
MRVE3	65%	35%	34,2	-30,0	65%	35%	42,3	-31,7	
MULT3	62%	38%	44,5	-37,1	58%	42%	44,0	-33,0	
NATU3	61%	39%	49,9	-49,7	59%	41%	66,0	-58,0	
PCAR4	66%	34%	70,0	-44,8	65%	35%	99,0	-50,0	
PETR3	63%	37%	54,9	-39,0	60%	40%	71,0	-58,0	
PETRA	58%	42%	51,5	-46,0	56%	44%	49,7	-47,8	
QUAL3	65%	35%	51,4	-43,3	62%	38%	72,2	-41,4	
RADL3	57%	43%	79,2	-74,8	55%	45%	100,4	-85,9	
RAIL3	65%	35%	45,1	-34,3	63%	37%	50,3	-29,0	
RENT3	65%	35%	70,9	-58,1	61%	39%	74,0	-57,4	
SANB11	61%	39%	50,0	-46,0	60%	40%	63,6	-41,4	
SBSP3	64%	36%	93,5	-67,0	60%	40%	90,0	-74,0	
SML3	62%	38%	30,6	-35,6	61%	39%	53,0	-57,8	
SUZB3	59%	41%	68,5	-59,2	55%	45%	75,6	-64,5	
TAE11	61%	39%	16,7	-10,0	57%	43%	13,4	-8,1	
TIMP3	64%	36%	14,3	-12,1	61%	39%	15,6	-10,2	
UGPA3	64%	36%	59,5	-39,8	60%	40%	77,0	-35,8	
USIM5	62%	38%	58,9	-42,0	60%	40%	60,0	-37,6	
VALE3	57%	43%	64,0	-54,6	55%	45%	70,1	-67,0	
VIVT4	60%	40%	33,8	-28,4	56%	44%	43,4	-34,5	
VVAR3	57%	43%	30,0	-22,1	55%	45%	40,0	-26,0	
WEG3	60%	40%	19,8	-18,8	58%	42%	20,0	-16,9	
YDUQ3	60%	40%	68,0	-66,6	60%	40%	89,7	-68,1	
ET1									
BOVA11		57%	43%	21,0	-13,2	52%	48%	29,5	-11,4
BOVV11		71%	29%	19,6	-5,2	56%	44%	16,1	-2,5
Futuros									
WDO	Vencimentos	50%	50%	70,0	-93,2	26%	74%	147,2	-215,0
WIN	1º vencimento	53%	47%	68,0	-90,5	27%	73%	176,7	-247,3
Opções de Compra	Intervalo de Delta (%)								
BBA33	0 ≤ Δ ≤ 20	49%	51%	40,0	-22,4	45%	55%	48,0	-35,1
BBA33	20 ≤ Δ ≤ 40	58%	42%	119,8	-65,0	58%	42%	126,0	-80,2
BBA33	40 ≤ Δ ≤ 60	68%	32%	164,8	-142,6	72%	28%	159,5	-120,0
BBA33	60 ≤ Δ ≤ 80	65%	35%	94,9	-104,7	75%	25%	182,0	-45,1
BBA33	80 ≤ Δ ≤ 100	73%	27%	57,8	-75,3	73%	27%	99,9	-57,7
ITUB4	0 ≤ Δ ≤ 20	53%	47%	39,9	-25,0	51%	49%	58,0	-40,1
ITUB4	20 ≤ Δ ≤ 40	58%	42%	69,9	-75,2	57%	43%	119,8	-100,0
ITUB4	40 ≤ Δ ≤ 60	69%	31%	149,6	-95,9	74%	26%	177,6	-100,2
ITUB4	60 ≤ Δ ≤ 80	74%	26%	172,8	-101,9	74%	26%	193,2	-70,3
ITUB4	80 ≤ Δ ≤ 100	82%	18%	101,4	-86,4	78%	22%	79,0	-53,5



ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (outubro/novembro/dezembro) - 2019

Opções de Compra	Intervalo de Delta (%)	% Médio Clientes		Ganho Diário Mediano (R\$)	Perda Diária Mediana (R\$)	% Médio Clientes		Ganho Mensal Mediano (R\$)	Perda Mensal Mediana (R\$)
		Ganhadores Por Dia	Perdedores Por Dia			Ganhadores Por Mês	Perdedores Por Mês		
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	48%	52%	104,7	-16,0	46%	54%	119,8	-65,0
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	57%	43%	139,5	-99,5	57%	43%	160,3	-110,6
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	63%	37%	179,4	-150,8	68%	32%	239,1	-164,0
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	65%	35%	199,2	-175,9	67%	33%	279,0	-181,7
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	60%	40%	110,8	-81,1	63%	37%	298,0	-151,3
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	55%	45%	79,8	-45,5	48%	52%	90,0	-60,1
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	59%	41%	129,7	-122,9	60%	40%	140,0	-156,3
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	64%	36%	197,6	-179,4	68%	32%	240,0	-155,7
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	71%	29%	175,6	-247,8	69%	31%	277,8	-183,7
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	58%	42%	165,6	-50,0	60%	40%	247,0	-80,3
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	56%	44%	35,0	-15,3	46%	54%	44,5	-30,0
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	57%	43%	41,9	-20,7	54%	46%	49,8	-20,0
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	59%	41%	55,9	-33,4	61%	39%	60,0	-30,4
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	67%	33%	60,1	-32,8	69%	31%	93,0	-58,2
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	57%	43%	50,5	-51,8	65%	35%	98,5	-58,0
Opções de Venda	Intervalo de Delta (%)								
BBAS3	0 ≤ Δ ≤ 20	52%	48%	76,4	-30,0	51%	49%	114,7	-43,1
BBAS3	20 ≤ Δ ≤ 40	55%	45%	120,0	-90,5	58%	42%	117,0	-90,6
BBAS3	40 ≤ Δ ≤ 60	75%	25%	196,0	-80,3	75%	25%	254,8	-72,7
BBAS3	60 ≤ Δ ≤ 80	55%	45%	38,5	-36,0	58%	42%	37,0	-40,0
BBAS3	80 ≤ Δ ≤ 100	59%	41%	36,4	-12,0	76%	24%	44,7	-17,0
ITUB4	0 ≤ Δ ≤ 20	65%	35%	28,6	-25,0	55%	45%	40,8	-27,5
ITUB4	20 ≤ Δ ≤ 40	60%	40%	56,0	-69,6	65%	35%	78,9	-49,1
ITUB4	40 ≤ Δ ≤ 60	66%	34%	95,6	-100,0	72%	28%	109,9	-75,1
ITUB4	60 ≤ Δ ≤ 80	78%	22%	289,3	-145,0	80%	20%	97,0	-105,1
ITUB4	80 ≤ Δ ≤ 100	72%	28%	172,0	-13,5	89%	11%	119,9	-20,1
PETR4	0 ≤ Δ ≤ 20	51%	49%	75,0	-25,0	47%	53%	126,5	-80,1
PETR4	20 ≤ Δ ≤ 40	56%	44%	104,9	-85,0	54%	46%	154,7	-120,3
PETR4	40 ≤ Δ ≤ 60	61%	39%	129,3	-98,0	68%	32%	148,0	-157,0
PETR4	60 ≤ Δ ≤ 80	63%	37%	139,0	-171,5	67%	33%	209,0	-120,6
PETR4	80 ≤ Δ ≤ 100	58%	42%	239,1	-60,6	60%	40%	261,7	-110,5
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	54%	46%	63,9	-45,7	50%	50%	102,0	-81,6
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	59%	41%	131,1	-105,3	60%	40%	149,2	-106,1
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	68%	32%	146,5	-115,0	69%	31%	220,5	-109,3
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	69%	31%	160,0	-173,0	73%	27%	189,8	-131,2
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	52%	48%	119,2	-265,6	71%	29%	100,0	-55,1
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	58%	42%	31,9	-18,8	45%	55%	60,0	-55,0
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	48%	52%	29,8	-32,5	48%	52%	15,0	-57,0
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	72%	28%	59,9	-43,4	60%	40%	90,0	-31,7
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	82%	18%	29,8	-50,1	83%	17%	69,3	-26,8
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	29%	71%	16,5	-107,5	30%	70%	59,3	-143,7



MÉTRICAS DE RISCO

	VaR 1d (99,96%)	Estresse Estatístico (99,96%)	Estresse Estatístico (0,04%)
Ações do Ibovespa			
ABEV3	4,3%	11,1%	-9,6%
AZUL4	5,9%	13,0%	-12,4%
B3SA3	7,7%	20,2%	-16,6%
BBAS3	5,3%	17,1%	-13,9%
BBDC3	5,1%	13,1%	-11,1%
BBDC4	4,5%	12,9%	-10,6%
BBSE3	4,4%	9,9%	-8,7%
BPAC11	6,2%	19,7%	-14,5%
BRAP4	4,5%	17,4%	-14,6%
BRDT3	5,2%	14,9%	-11,5%
BRFS3	6,3%	15,3%	-12,5%
BRKM5	6,2%	18,4%	-14,0%
BRML3	4,6%	20,3%	-14,9%
BTOW3	7,1%	24,4%	-17,9%
CCRO3	6,0%	17,1%	-14,0%
CIEL3	8,6%	12,9%	-11,1%
CMIG4	4,0%	15,0%	-12,7%
COGN3	8,3%	17,1%	-14,3%
CSAN3	5,2%	18,3%	-15,8%
CSNA3	8,2%	21,0%	-16,2%
CVCB3	7,5%	13,4%	-10,4%
CYRE3	5,7%	28,5%	-20,5%
ECOR3	5,8%	12,2%	-10,4%
EGIE3	5,4%	18,5%	-14,6%
ELET3	6,8%	21,1%	-15,7%
ELET6	5,0%	18,4%	-14,2%
EMBR3	3,5%	15,4%	-12,9%
ENBR3	3,6%	31,6%	-23,0%
EQTL3	4,6%	11,7%	-10,3%
FLRY3	4,9%	10,9%	-9,1%
GGBR4	7,3%	15,4%	-12,5%
GNDI3	6,8%	7,9%	-6,4%
GOAU4	7,5%	18,0%	-14,9%
GOLL4	7,5%	30,2%	-19,4%
HYPE3	4,4%	16,8%	-13,4%
IGTA3	4,2%	12,8%	-10,7%
IRBR3	5,2%	9,5%	-6,9%
ITSA4	3,7%	13,8%	-11,2%
ITUB4	4,5%	14,3%	-11,5%
JBSS3	7,5%	23,3%	-17,6%
KLBN11	4,2%	15,1%	-12,2%
LAME4	7,3%	16,8%	-13,0%
LREN3	4,4%	17,0%	-13,0%
MGLU3	6,6%	29,8%	-20,1%
MRFG3	8,4%	23,3%	-16,8%
MRVE3	9,4%	21,5%	-17,4%
MULT3	4,9%	15,7%	-12,8%
NATU3	6,1%	13,3%	-10,6%
PCAR4	5,0%	12,4%	-10,7%
PETR3	5,1%	18,5%	-15,7%
PETR4	5,0%	17,8%	-15,9%
QUAL3	7,4%	18,8%	-15,4%
RADI3	5,3%	27,0%	-18,0%
RAIL3	4,9%	25,6%	-20,4%
RENT3	6,4%	17,8%	-13,7%
SANB11	4,6%	11,0%	-9,5%
SBSP3	5,6%	13,7%	-12,3%
SMLS3	12,2%	22,0%	-18,7%
SUZB3	5,4%	14,4%	-11,6%
TAEI1	2,6%	18,0%	-14,3%
TIMP3	5,4%	20,7%	-16,3%
UGPA3	6,2%	12,6%	-10,6%
USIM5	6,4%	21,5%	-16,4%
VALE3	4,2%	17,1%	-14,6%
VIVT4	3,2%	9,4%	-8,2%
VVAR3	10,4%	22,0%	-16,0%
WEGE3	6,1%	20,2%	-15,5%
YDUQ3	0,3%	22,0%	-17,7%
ETJ			
BOVA11	2,6%	8,2%	-7,7%
BOVV11	2,7%	6,5%	-6,8%
Spots			
USD/BRL	1,6%	7,7%	-6,3%
Ibovespa	2,7%	9,7%	-9,7%
ETT J (bps)			
Pré 1 ano	14,97	35,88	-30,19
Pré 3 anos	24,56	49,49	-39,37
Pré 5 anos	23,75	70,50	-57,72
Cupom de IPCA 1 ano	143,32	9,44	-7,60
Cupom de IPCA 5 anos	18,13	34,83	-27,84
Cupom de IPCA 10 anos	15,90	63,51	-50,87
Cupom de IPCA 15,5 anos	14,46	70,51	-57,68