

ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA

Trimestre (novembro-19/dezembro-19/janeiro-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	63%	37%	17,51	-10,16	61%	39%	14,85	-10,00	
AZUL4	62%	38%	71,18	-67,02	61%	39%	86,00	-69,12	
B3SA3	61%	39%	63,00	-49,62	59%	41%	74,60	-58,80	
BBAS3	57%	43%	79,50	-63,96	54%	46%	80,63	-71,52	
BBDC3	64%	36%	53,82	-45,34	62%	38%	46,75	-26,27	
BBDC4	59%	41%	57,11	-50,27	57%	43%	59,75	-49,80	
BBSE3	60%	40%	29,94	-25,25	55%	45%	37,73	-34,52	
BPAC11	63%	37%	89,87	-79,91	60%	40%	112,50	-86,02	
BRAP4	58%	42%	61,39	-42,62	54%	46%	66,96	-46,69	
BRDT3	68%	32%	62,69	-33,84	63%	37%	68,00	-36,42	
BRFS3	57%	43%	72,93	-65,40	53%	47%	87,75	-87,02	
BRKM5	60%	40%	82,00	-69,59	58%	42%	90,68	-78,15	
BRML3	62%	38%	35,56	-20,50	57%	43%	33,76	-14,57	
BTOW3	59%	41%	112,31	-99,00	58%	42%	125,50	-113,59	
CCRO3	62%	38%	50,50	-30,32	61%	39%	64,86	-33,64	
CIEL3	59%	41%	39,16	-33,50	57%	43%	40,00	-33,00	
CMIG4	62%	38%	42,33	-19,76	61%	39%	40,32	-18,00	
COGN3	63%	37%	46,83	-33,53	61%	39%	60,44	-30,00	
CRFB3	65%	35%	44,80	-34,47	62%	38%	53,88	-39,31	
CSAN3	59%	41%	63,35	-53,54	57%	43%	76,54	-57,92	
CSNA3	59%	41%	75,50	-57,58	55%	45%	78,00	-57,00	
CVCB3	58%	42%	54,04	-48,20	54%	46%	68,66	-44,23	
CYRE3	64%	36%	39,18	-27,20	62%	38%	39,00	-27,93	
ECOR3	64%	36%	33,74	-25,15	62%	38%	37,67	-19,00	
EGIE3	60%	40%	29,08	-23,50	58%	42%	37,28	-22,11	
ELET3	62%	38%	80,00	-66,22	60%	40%	104,24	-61,29	
ELET6	68%	32%	75,83	-52,73	64%	36%	98,57	-53,80	
EMBR3	63%	37%	19,44	-12,10	58%	42%	18,00	-12,21	
ENBR3	63%	37%	11,48	-5,91	58%	42%	7,69	-5,17	
EQTL3	67%	33%	44,06	-33,94	61%	39%	50,82	-30,62	
FLRY3	61%	39%	16,89	-15,81	56%	44%	17,88	-15,85	
GGBR4	59%	41%	58,91	-45,02	57%	43%	52,00	-49,66	
GNDI3	60%	40%	78,23	-75,49	55%	45%	108,69	-84,58	
GOAU4	62%	38%	47,14	-30,33	60%	40%	38,95	-20,26	
GOLL4	58%	42%	95,13	-86,54	56%	44%	109,85	-92,70	
HAPV3	62%	38%	117,71	-83,03	57%	43%	140,76	-77,80	
HGTX3	63%	37%	72,55	-42,65	62%	38%	82,00	-60,00	
HYPE3	60%	40%	36,18	-31,49	56%	44%	40,50	-34,27	
IGTA3	68%	32%	54,02	-32,66	64%	36%	59,18	-43,37	
IRBR3	66%	34%	67,77	-41,14	66%	34%	77,45	-50,67	
ITSA4	60%	40%	15,41	-10,97	56%	44%	11,56	-7,89	
ITUB4	59%	41%	49,60	-42,39	56%	44%	53,13	-41,73	
JBSS3	60%	40%	71,21	-64,43	58%	42%	72,00	-57,00	
KLBN11	62%	38%	28,96	-21,64	58%	42%	24,48	-22,00	
LAME4	62%	38%	35,85	-34,74	62%	38%	33,81	-32,97	
LEN3	66%	34%	58,98	-36,26	61%	39%	58,36	-35,72	
MGLU3	60%	40%	61,90	-59,62	58%	42%	59,21	-54,71	
MRFG3	60%	40%	44,92	-29,07	57%	43%	49,85	-39,00	
MRVE3	64%	36%	37,17	-32,28	66%	34%	43,00	-33,23	
MULT3	62%	38%	55,20	-37,79	60%	40%	52,00	-33,00	
NTCO3	65%	35%	70,26	-50,46	64%	36%	71,47	-58,00	
PCAR4	66%	34%	74,31	-48,53	66%	34%	100,19	-50,00	
PETR3	60%	40%	52,69	-38,80	57%	43%	71,00	-58,00	
PETR4	57%	43%	48,01	-40,99	55%	45%	49,66	-47,84	
QUAL3	66%	34%	68,55	-46,83	64%	36%	89,71	-41,40	
RADL3	58%	42%	90,28	-76,67	54%	46%	100,44	-91,13	
RAIL3	64%	36%	45,05	-33,27	63%	37%	51,00	-35,59	
RENT3	65%	35%	64,31	-41,28	62%	38%	70,00	-43,60	
SANB11	61%	39%	49,82	-44,42	56%	44%	63,64	-41,41	
SBSP3	64%	36%	87,47	-65,34	60%	40%	90,00	-74,00	
SMLS3	60%	40%	36,09	-39,83	60%	40%	45,35	-57,83	
SULA11	67%	33%	88,87	-49,11	62%	38%	100,00	-49,20	
SUZB3	61%	39%	78,88	-60,63	58%	42%	86,73	-60,00	
TAE11	62%	38%	17,25	-10,36	59%	41%	15,00	-6,80	
TIMP3	64%	36%	15,73	-13,13	62%	38%	15,68	-14,66	
TOTS3	64%	36%	118,29	-57,55	62%	38%	84,87	-49,37	
UGPA3	65%	35%	65,82	-42,78	62%	38%	77,00	-49,51	
USIM5	60%	40%	60,58	-46,90	57%	43%	63,85	-40,25	
VALE3	57%	43%	66,36	-54,03	54%	46%	75,00	-67,03	
VIVT4	61%	39%	35,86	-30,18	58%	42%	44,12	-34,53	
VVAR3	57%	43%	38,37	-33,50	56%	44%	40,55	-35,26	
WEGE3	60%	40%	21,69	-18,53	58%	42%	20,00	-16,90	
YDUQ3	62%	38%	65,30	-67,11	60%	40%	89,70	-56,00	
ETF									
BOVA11	55%	45%	20,86	-14,47	51%	49%	29,46	-16,43	
BOVV11	64%	36%	20,21	-6,76	51%	49%	15,41	-2,50	
Futuros	Vencimentos								
WDO	1º vencimento	49%	51%	65,75	-90,00	26%	74%	115,00	-198,36
WIN	1º vencimento	53%	47%	68,60	-95,16	27%	73%	175,80	-247,28
Opções de Compra	Intervalo de Delta (%)								
BBAS3	0 ≤ Δ ≤ 20	50%	50%	39,94	-29,97	47%	53%	47,98	-45,77
BBAS3	20 ≤ Δ ≤ 40	57%	43%	123,65	-123,57	59%	41%	124,73	-80,93
BBAS3	40 ≤ Δ ≤ 60	66%	34%	184,93	-124,03	71%	29%	157,00	-120,00
BBAS3	60 ≤ Δ ≤ 80	67%	33%	138,23	-100,93	74%	26%	228,49	-45,07
BBAS3	80 ≤ Δ ≤ 100	78%	22%	73,14	-63,13	73%	27%	122,31	-66,18
ITUB4	0 ≤ Δ ≤ 20	50%	50%	46,16	-41,27	49%	51%	73,01	-50,07
ITUB4	20 ≤ Δ ≤ 40	58%	42%	92,30	-82,57	53%	47%	124,49	-100,00
ITUB4	40 ≤ Δ ≤ 60	66%	34%	149,44	-85,37	69%	31%	177,60	-96,72
ITUB4	60 ≤ Δ ≤ 80	68%	32%	205,00	-120,00	64%	36%	193,18	-70,26
ITUB4	80 ≤ Δ ≤ 100	67%	33%	239,97	-89,76	68%	32%	178,29	-52,87

ESTATÍSTICAS DE DAY-TRADE DE PESSOA FÍSICA
Trimestre (novembro-19/dezembro-19/janeiro-20)

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\$)
PETRA	0 ≤ Δ ≤ 20	48%	52%	113,96	-13,52	45%	55%	119,85	-65,01
PETRA	20 ≤ Δ ≤ 40	56%	44%	138,10	-88,19	56%	44%	163,77	-100,00
PETRA	40 ≤ Δ ≤ 60	62%	38%	189,12	-150,84	67%	33%	218,31	-164,00
PETRA	60 ≤ Δ ≤ 80	65%	35%	199,45	-179,26	69%	31%	305,44	-208,88
PETRA	80 ≤ Δ ≤ 100	65%	35%	110,22	-87,66	63%	37%	215,00	-151,34
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	55%	45%	74,95	-47,81	47%	53%	90,00	-60,14
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	60%	40%	139,60	-134,21	60%	40%	140,00	-156,29
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	66%	34%	207,00	-183,28	69%	31%	274,52	-160,47
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	72%	28%	210,27	-246,37	69%	31%	349,37	-183,70
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	64%	36%	197,34	-181,05	59%	41%	296,92	-186,80
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	56%	44%	32,00	-15,02	51%	49%	44,84	-36,14
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	61%	39%	44,54	-37,82	58%	42%	54,91	-37,26
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	64%	36%	63,89	-40,31	65%	35%	73,00	-46,00
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	69%	31%	95,23	-60,50	71%	29%	95,94	-61,64
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	56%	44%	53,07	-59,56	66%	34%	111,91	-58,02
Opções de Venda	Intervalo de Delta (%)								
BBAS3	0 ≤ Δ ≤ 20	55%	45%	60,19	-42,61	49%	51%	50,48	-43,05
BBAS3	20 ≤ Δ ≤ 40	52%	48%	171,73	-51,08	56%	44%	169,79	-49,03
BBAS3	40 ≤ Δ ≤ 60	77%	23%	174,73	-99,00	77%	23%	254,82	-73,50
BBAS3	60 ≤ Δ ≤ 80	71%	29%	61,38	-33,00	69%	31%	37,00	-40,04
BBAS3	80 ≤ Δ ≤ 100	65%	35%	44,59	-11,82	77%	23%	134,34	-127,12
ITUB4	0 ≤ Δ ≤ 20	59%	41%	22,42	-22,52	51%	49%	32,97	-27,51
ITUB4	20 ≤ Δ ≤ 40	60%	40%	52,35	-59,64	66%	34%	60,00	-54,02
ITUB4	40 ≤ Δ ≤ 60	73%	27%	109,93	-100,00	75%	25%	119,49	-100,00
ITUB4	60 ≤ Δ ≤ 80	76%	24%	94,69	-68,00	77%	23%	97,39	-150,00
ITUB4	80 ≤ Δ ≤ 100	67%	33%	26,61	-18,57	77%	23%	119,89	-20,09
PETRA	0 ≤ Δ ≤ 20	50%	50%	87,28	-20,01	46%	54%	126,54	-80,08
PETRA	20 ≤ Δ ≤ 40	59%	41%	112,56	-89,32	54%	46%	154,68	-120,28
PETRA	40 ≤ Δ ≤ 60	63%	37%	139,86	-97,03	68%	32%	148,95	-126,68
PETRA	60 ≤ Δ ≤ 80	64%	36%	147,13	-124,96	69%	31%	246,93	-100,00
PETRA	80 ≤ Δ ≤ 100	62%	38%	180,00	-75,31	66%	34%	261,68	-110,47
VALE3	0 ≤ Δ ≤ 20	55%	45%	72,42	-51,76	50%	50%	101,98	-100,62
VALE3	20 ≤ Δ ≤ 40	61%	39%	149,62	-126,37	61%	39%	161,19	-183,00
VALE3	40 ≤ Δ ≤ 60	67%	33%	160,00	-173,48	68%	32%	220,48	-180,00
VALE3	60 ≤ Δ ≤ 80	70%	30%	163,79	-210,95	71%	29%	189,81	-185,63
VALE3	80 ≤ Δ ≤ 100	59%	41%	236,02	-244,03	73%	27%	100,00	-49,00
VVAR3	0 ≤ Δ ≤ 20	61%	39%	31,77	-15,01	44%	56%	60,00	-35,00
VVAR3	20 ≤ Δ ≤ 40	54%	46%	34,58	-35,57	55%	45%	40,00	-62,48
VVAR3	40 ≤ Δ ≤ 60	66%	34%	59,94	-60,07	62%	38%	90,00	-60,07
VVAR3	60 ≤ Δ ≤ 80	69%	31%	68,88	-50,10	75%	25%	147,00	-34,08
VVAR3	80 ≤ Δ ≤ 100	29%	71%	16,50	-107,51	30%	70%	59,35	-143,66

MÉTRICAS DE RISCO

	VaR 1d (99,96%)	Estresse Estatístico (99,96%)	Estresse Estatístico (0,04%)
Ações do Ibovespa			
ABEV3	5,2%	11,1%	-9,6%
AZUL4	9,5%	13,1%	-12,4%
B3SA3	8,0%	20,2%	-16,5%
BBAS3	6,5%	17,1%	-13,5%
BBDC3	5,9%	13,1%	-11,0%
BBDC4	5,6%	12,8%	-10,6%
BBSE3	4,1%	9,9%	-8,6%
BPAC11	6,1%	19,6%	-14,6%
BRAP4	7,0%	17,5%	-14,6%
BRDT3	5,5%	14,7%	-11,5%
BRFS3	6,9%	15,3%	-12,5%
BRKM5	10,5%	18,4%	-14,0%
BRML3	5,2%	20,2%	-14,8%
BTOW3	8,6%	24,4%	-17,9%
CCRO3	6,5%	17,0%	-13,9%
CIEL3	8,3%	12,8%	-11,1%
CMIG4	4,8%	15,0%	-12,7%
COGN3	8,2%	17,0%	-14,2%
CRFB3	7,1%	7,2%	-6,8%
CSAN3	5,7%	18,2%	-15,8%
CSNA3	10,6%	21,0%	-16,1%
CVCB3	7,7%	13,2%	-10,4%
CYRE3	7,0%	28,5%	-20,4%
ECOR3	6,3%	12,2%	-10,3%
EGIE3	4,1%	18,5%	-14,6%
ELET3	8,1%	21,1%	-15,7%
ELET6	6,0%	18,4%	-14,2%
EMBR3	4,2%	15,4%	-12,9%
ENBR3	4,2%	31,5%	-23,0%
EQT3	4,5%	11,7%	-10,3%
FLRY3	5,9%	10,8%	-9,0%
GGBR4	9,1%	15,4%	-12,5%
GNDI3	7,5%	7,7%	-6,4%
GOAU4	9,7%	17,9%	-14,9%
GOLL4	9,7%	30,0%	-19,3%
HAPV3	7,1%	9,2%	-8,0%
HGTX3	10,7%	38,1%	-25,3%
HYPE3	5,7%	16,7%	-13,3%
IGTA3	5,0%	12,8%	-10,7%
IRBR3	7,6%	9,6%	-6,7%
ITSA4	4,6%	13,8%	-11,2%
ITUB4	5,0%	14,2%	-11,5%
JBSS3	8,5%	23,2%	-17,6%
KLBN11	6,8%	15,1%	-12,2%
LAME4	6,2%	16,7%	-13,0%
LREN3	5,0%	17,0%	-12,9%
MGLU3	7,9%	29,7%	-20,0%
MRFG3	9,5%	23,1%	-16,8%
MRVE3	8,7%	21,5%	-17,4%
MULT3	4,5%	15,6%	-12,8%
NTCO3	8,1%	13,3%	-10,5%
PCAR4	5,7%	12,4%	-10,7%
PETR3	6,2%	18,4%	-15,6%
PETR4	5,3%	17,8%	-15,9%
QUAL3	8,3%	18,7%	-15,2%
RADL3	6,8%	27,1%	-18,0%
RAIL3	5,3%	25,5%	-20,4%
RENT3	5,9%	17,8%	-13,6%
SANB11	5,9%	10,9%	-9,5%
SBSP3	6,7%	13,7%	-12,3%
SMLS3	7,7%	21,8%	-18,6%
SULA11	6,7%	12,4%	-10,5%
SUZB3	8,1%	14,4%	-11,6%
TAE11	3,5%	17,9%	-14,3%
TIMP3	5,1%	20,7%	-16,3%
TOTS3	6,7%	12,2%	-10,1%
UGPA3	7,0%	12,6%	-10,5%
USIM5	12,1%	21,6%	-16,5%
VALE3	7,0%	17,1%	-14,6%
VIVT4	3,6%	9,4%	-8,2%
VVAR3	11,7%	21,9%	-16,0%
WEGE3	8,0%	20,2%	-15,5%
YDUQ3	0,1%	22,1%	-17,8%
ETFs			
BOVA11	4,4%	8,2%	-7,7%
BOVV11	4,2%	6,5%	-6,8%
Spots			
USD/BRL	1,9%	7,7%	-6,3%
Ibovespa	4,2%	9,7%	-9,6%
ETTJ (bps)			
Pré 1 ano	11,29	34,67	-29,29
Pré 3 anos	18,06	47,49	-37,76
Pré 5 anos	16,73	68,28	-55,72
Cupom de IPCA 1 ano	272,51	36,76	-27,92
Cupom de IPCA 5 anos	12,80	34,88	-27,71
Cupom de IPCA 10 anos	12,08	63,31	-50,69
Cupom de IPCA 15,5 anos	10,95	72,26	-59,07