

# RELATÓRIO MENSAL

**TANGRAM**  
PLUS

**06/2020**

## Caro cliente,

Apresentamos a você o relatório referente ao mês de junho dos placares da estratégia Tangram Plus. Neste relatório, vamos expor o que ocorreu no mercado no último mês e como os placares performaram.

## Resumo do Mercado

O Ibovespa terminou o mês de junho com alta de 8,76%, aos 95.056 pontos. Pela cotação do Banco Central (Ptax 800), o Dólar teve alta de +2,09% no mês, cotado a R\$ 5,48. O Euro também teve desvalorização de +3,14% em junho frente ao real, fechando o mês em R\$ 6,15.

## Cenário Externo

A pandemia de coronavírus continua sendo o maior obstáculo para a economia mundial e isso ficou claro no decorrer de junho. Muitos países pareciam ter superado a pior fase do vírus e iniciaram a reabertura das atividades, mas a incidência de novos casos trouxe preocupação sobre o ritmo de recuperação das economias. Mesmo com essa situação, a possibilidade de imposição de uma nova quarentena foi descartada por alguns líderes mundiais, principalmente pelo presidente americano Donald Trump.

Em meio às notícias negativas relacionadas à pandemia, no entanto, dados econômicos divulgados no mês indicaram a retomada dos setores industriais e de serviços, principalmente na China, Europa e Estados Unidos. O mercado de trabalho americano, inclusive, começou a mostrar força: enquanto os pedidos semanais de seguro-desemprego reduziram o ritmo em junho, o resultado da taxa de desemprego surpreendeu e caiu de 13,3% para 11,1%, quando a expectativa era de 12,3% no período.

Nesse contexto, os bancos centrais continuaram a expandir o estímulo monetário, com o Banco Central Europeu anunciando pacotes que chegaram a 1,35 trilhões de euros. O Fed, instituição monetária americana, sinalizou que deve subir juros apenas em 2022.

As tensões entre China e Estados Unidos esfriaram no decorrer do mês e também contribuíram para o bom desempenho dos mercados internacionais em junho, com o S&P fechando em alta de mais de 2% e o Dow Jones com +1,39%.

## Cenário Doméstico

Enquanto outros países enfrentam uma segunda onda de infecções por Covid-19, o Brasil ainda está na primeira onda de casos e já se tornou o segundo maior em número de casos, atrás apenas dos Estados Unidos. Após as saídas de Mandetta e Teich, não houve uma substituição oficial e o Ministério da Saúde tem sido conduzido de forma interina. Além disso, o Ministro da Educação também deixou o cargo. A administração Bolsonaro tem mantido uma relação difícil com o Legislativo e o Judiciário, o que aumenta a tensão política e o risco de investimento no país.

Como esperado pelo mercado, o comitê do Banco Central promoveu mais um corte na SELIC após a reunião de junho, renovando a mínima histórica para a taxa de juros, agora em 2,25%, e deixando aberta a possibilidade de mais um ajuste no indicador. A economia brasileira iniciou a retomada da atividade apesar do aumento de casos de coronavírus em todo o território nacional.

Seguindo o cenário favorável do exterior, o Ibovespa fechou o mês em terreno positivo e teve o melhor trimestre (abril a junho) desde 2003. O dólar oscilou frente ao real no decorrer do período, mas fechou acima de R\$ 5,00, refletindo maior aversão ao risco por parte dos investidores.

## Performance dos robôs

Mês de abril o mercado teve uma volatilidade um pouco mais reduzida, os robôs dos placares apresentaram a seguinte performance:

- 1) Mês de junho - 01/06/2020 à 30/05/2020.
- 2) Desde o lançamento da estratégia - 16/12/2019 à 30/06/2020;

A seguir, será apresentado os cinco robôs que melhor performaram e os cinco que apresentaram a pior performance no período analisado:

- Robôs de Mini índice (WIN) mês de Junho:

Robô	Saldo
Teresina	+ R\$ 1815,00
Manaus	+ R\$ 1598,00
Goiás	+ R\$ 1593,00
Porto Alegre	+ R\$ 1473,50
Valeta	+ R\$ 1403,00
Cuiabá	- R\$ 1466,00
Bahia	- R\$ 1545,00
Belém	- R\$ 1689,00
Boa Vista	- R\$ 2059,00
Florianópolis	- R\$ 2335,50

- Robôs de Mini índice (WIN) desde o lançamento:

Robô	Saldo
Porto Alegre	+ R\$ 5131,00
Guarapari	+ R\$ 3315,00
Campo Grande	+ R\$ 2623,00
Recife	+ R\$ 2616,00
Lima	+ R\$ 2219,00
Manaus	- R\$ 4918,00
Manama	- R\$ 5093,00
Pernambuco	- R\$ 5446,00
Amapá	- R\$ 6288,00

<b>Boa Vista</b>	<b>- R\$ 11308,00</b>
------------------	-----------------------

- Robôs de Mini dólar (WDO) mês de Junho:

<b>Robô</b>	<b>Saldo</b>
Paraguai	+ R\$ 2639,00
Países Baixos	+ R\$ 1858,00
Camarões	+ R\$ 1511,00
Israel	+ R\$ 1476,00
Suíça	+ R\$ 1185,00
Costa do Marfim	- R\$ 4015,00
Estônia	- R\$ 4539,00
Portugal	- R\$ 5422,00
Turquia	- R\$ 5843,00
Irlanda	- R\$ 11471,00

- Robôs de Mini dólar (WDO) desde o lançamento:

<b>Robô</b>	<b>Saldo</b>
Tunísia	+ R\$ 1257,00
Áustria	+ R\$ 1141,00
Itália	+ R\$ 1006,00
Dinamarca	+ R\$ 118,00
Austrália	+ R\$ 56,00
Costa do Marfim	- R\$ 21575,00
Quênia	- R\$ 21702,00
Irlanda	- R\$ 28808,00
Estônia	- R\$ 30746,00

<b>Portugal</b>	<b>- R\$ 53686,00</b>
-----------------	-----------------------

O placar de WIN continua se mantendo muito melhor do que o de WDO, tendo muito mais robôs vencedores. Desde o lançamento da estratégia, os robôs de WIN também apresentaram um retorno melhor do que os robôs de WDO.

Visando sempre oferecer os melhores robôs para os assinantes da estratégia, iremos dentro de alguns dias realizar uma forte atualização no placar de WDO, fazendo com que assim a gama de possibilidades para uma boa montagem de uma carteira diversificada de robôs possa ocorrer.

## Fechamento

O pré-lançamento da Tangram Plus ocorreu no dia 16/12/2019 contendo dois placares e mais de 200 robôs para os assinantes copiarem ou se inspirarem, foi disponibilizado ferramentas para que os clientes consigam montar uma carteira diversificada de robôs com o intuito de que ocorra a diminuição do risco.

As ordens dos dias de alta volatilidades com diversos circuit breaker foram retiradas devido a diversos robôs terem o seu gain/loss ultrapassados, deixando assim o ranking de robôs não condizente com os dias normais de mercado, prejudicando novos usuários na análise e escolha dos robôs.

Como citado, o placar de WIN obteve uma melhor performance do que o de WDO, possuindo um maior número de robôs que fecharam positivamente nos dois períodos analisados. Reforço a importância em usufruir das matrizes de correlações disponibilizadas envolvendo os placares da estratégia Tangram Plus. Com ela é possível selecionar robôs que possuam correlação voltada a zero, diminuindo o risco da carteira de robôs e maximizando o retorno a médio e longo prazo.

Por fim, iremos em breve realizar uma atualização do placar de WDO, visando oferecer bons robôs para os usuários copiarem ou se inspirarem para a criação de novos setups.

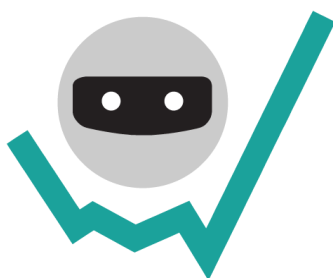


Para assinar a Tangram Plus, [clique aqui](#).

Se preferir, nos envie um e-mail para:

[suporte@smarttbot.com](mailto:suporte@smarttbot.com)

Ou ligue para: [\(11\) 4118-0492](tel:(11)4118-0492) / [\(31\) 2573-0048](tel:(31)2573-0048)



# SmarttBot