

RELATÓRIO MENSAL



Pontos
Pivot
Plus

06/2020

Caro cliente,

Apresentamos a você o relatório referente ao mês de junho do placar da estratégia Pontos Pivot Plus. Neste relatório, vamos expor o que ocorreu no mercado no último mês e como o placar performou.

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

A seguir, será apresentado o desempenho dos 75 robôs desde o dia do lançamento (12/05/2020):

Nome	Ativo	ID	Resultado
Betty Boop	WIN	1570104	937
Pato Donald	WIN	1570105	686
Skate 2.0	WIN	1569942	593
Muttley	WIN	1560863	495
Wolverine	RAIL3	1456761	403
Cebolinha	WIN	1560864	402,5
Pateta	WIN	1563952	348
Jorel	EMBR3	1456768	253
Varys	ABEV3	1456772	190
Pé de Pano	WIN	1560859	186
Anibal	AALR3	1456754	183
Pica-Pau	WIN	1563954	173
Picolino	WIN	1560862	152
Fred Flinstone	WIN	1563951	137
Tempestade	AALR3	1456763	130
Ciclope	RAIL3	1456769	118
Justiceiro	RAIL3	1456762	97
Homer Simpson	WIN	1563955	96
Sansa Stark	HBOR3	1456771	94
Leonidas	RAIL3	1456755	91
Mickey	WIN	1563950	75
Daenerys	ABEV3	1456775	51
Lobo	AALR3	1456757	50
Pacal	AALR3	1456756	46
Thanos	RAIL3	1456758	42
Link	CAML3	1456790	31
Carl Johnson	GOLL4	1456791	31
Aladdin	MOVI3	1456776	24

Jon Snow	GFSA3	1456770	3
Maximus	RAIL3	1456752	-12
Kitana	MOVI3	1456781	-24
Galactus	RAIL3	1456766	-41
Pernalonga	WIN	1560872	-46
Minnie	WIN	1560873	-50
Wilma Flinstone	WIN	1560871	-67,5
Noturno	SUZB3	1456760	-104
Popeye	WIN	1563953	-107
Gato Félix	WIN	1560867	-115
Tarzan	ABEV3	1456764	-137
Zaratrusta	RAIL3	1456750	-175
Sonic	TGMA3	1459717	-185
Zé Jacaré	WIN	1560861	-245
Guile	GOLL4	1456789	-295
Han solo	WDO	1569292	-323,4
Atila	WDO	1569303	-368,6
Eric Cartman	WIN	1560866	-395
Blanka	WDO	1569309	-433,6
Frodo	WDO	1569284	-492,8
Arya	WDO	1569304	-530,4
Liu Kang	WDO	1569311	-538,4
Luke Skywalker	WDO	1569299	-544,8
Ryu	WDO	1569312	-560,2
Darth Vader	WDO	1569290	-598,6
Corleone	WDO	1569293	-598,6
Aragorn	WDO	1569296	-670,4
Gandalf	WDO	1569295	-675,2
Piper Malibu 2.0	WIN	1569919	-697
Gollum	WDO	1569294	-713,4
Rocky Balboa	WDO	1569298	-716,8
Raiden	WDO	1569307	-806,8
Tyler Durden	WDO	1569289	-846,8
Coringa	WDO	1569291	-851,8

Neo	WDO	1569308	-870,4
Piu Piu	WIN	1560869	-908
Kruger	WDO	1569301	-958,8
Gargula	WDO	1569306	-993,8
Jerry	WIN	1560870	-1083
Papa-Léguas	WIN	1560865	-1089
Princesa Leia	WDO	1569300	-1120
Orfeu	WDO	1569302	-1161,8
Catatau	WIN	1560868	-1188
Pluto	WIN	1560860	-1330
Faramir	WDO	1569286	-1441,2
Legolas	WDO	1569287	-1494,6
Sauron	WDO	1569288	-1609,4

Performance dos Placares

O placar melhorou muito a sua performance comparado ao relatório passado, podemos aferir isso ao fato do mercado ter andado bastante no mês de junho, o que é bom para os robôs que utilizam o indicador pontos pivot.

Fechamento

A atualização da Pontos Pivot para Pontos Pivot Plus aconteceu no dia 12/05/2020 contendo um placar multi ativos com 75 robôs no qual os usuários possam copiar ou se inspirar para criar novos setups, foi disponibilizado ferramentas para que se possa montar uma carteira diversificada de robôs com o intuito de que ocorra a diminuição do risco.

Reforço a importância em usufruir da matriz de correlação disponibilizada envolvendo o placar da estratégia. Com ela é possível selecionar robôs que possuam correlação próxima de zero, diminuindo o risco da carteira de robôs e maximizando o retorno a médio e longo prazo.

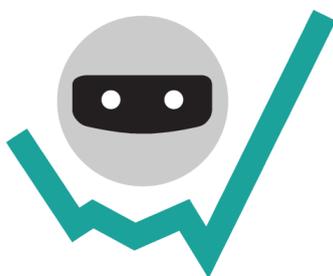


Para assinar a Tangram Plus, [clique aqui](#).

Se preferir, nos envie um e-mail:

suporte@smarttbot.com

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



SmarttBot