

Resumo

Neste relatório fornecemos um panorama sobre os indicadores técnicos dos principais ativos negociados no mercado. Os indicadores técnicos são segmentados em **4 seções**, que apresentam dados de: **(i)** Retornos e tendências para índices e ações; **(ii)** Volume negociado e Índice de Força Relativa (IFR); **(iii)** Médias móveis de 21 dias e 200 dias; e, **(iv)** Beta e volatilidade anuais.

Os ativos analisados incluem:

- **Índices de Mercado:** IBOV, SMLL, IDIV, DJIA, S&P 500, BTCUSD;
- **Índices Setoriais:** BDRX, ICON, IEEX, IFNC, IMOB, IMAT, INDX e UTIL; e,
- Ações listadas no Índice Brasil Amplo (IBRA).

Abaixo, realizamos uma descrição dos principais indicadores e a sua interpretação:

- **Tendência:** **(i)** ↑ para ativos acima das suas médias móveis de 21 e 200 dias; **(ii)** ↓ para ativos abaixo das suas médias móveis de 21 e 200 dias; e, **(iii)** ↔ para ativos sem tendência definida;
- **IFR:** **(i)** IFR acima de 70 geralmente indica uma condição de sobrecompra e que o ativo pode estar prestes a enfrentar uma correção ou reversão de preço; **(ii)** IFR abaixo de 30 geralmente indica uma condição de sobrevenda e que o ativo pode estar prestes a ter um aumento de preço; e, **(iii)** valores de IFR ao redor de 50 indicam que o ativo está sendo negociado aproximadamente ao seu valor justo;
- **Volume:** Volumes altos geralmente confirmam tendências nos preços. Sendo assim, este indicador deve ser analisado juntamente com a variação no preço do ativo subjacente;
- **Beta:** É um indicador que mede a volatilidade de um ativo individual em relação à volatilidade do mercado como um todo. Quanto maior o Beta, mais volátil é o ativo em relação ao seu indicador de referência (IBOVESPA);
- **Volatilidade:** Ações com alta volatilidade podem mudar drasticamente em um curto período de tempo em qualquer direção. Em ações de baixa volatilidade, seu preço não flutua drasticamente, mas muda a um ritmo constante ao longo de um período de tempo. Ações mais voláteis são normalmente consideradas mais arriscadas.

TC Matrix

Carlos André M. Vieira
Analista-Chefe, CNPI-P
carlos.vieira@tc.com.br

Tenha acesso a análises, relatórios e estratégias de investimento na comunidade do TC. Assine o plano Master [clikando aqui](#) ou pelo QR Code abaixo:





Indicadores | Índices

Principais Indicadores de Mercado

	Indicador	Último	Δ Semana	Δ Mês	Δ 12 meses	IFR	Média 21d	Média 200d	Tendência
1	IBOV	124.639	+4,7	+7,0	+13,1	84,6	116.747	112.599	↑
2	SMLL	2.198	+6,0	+8,0	+5,2	73,2	2.034	2.073	↑
3	IDIV	8.471	+4,9	+7,7	+20,5	87,1	7.923	7.546	↑
4	DJIA	34.945	+3,1	+2,8	+4,1	90,2	33.698	33.828	↑
5	S&P 500	4.508	+3,7	+3,1	+13,9	91,7	4.309	4.269	↑
6	BTCUSD	36.140	-1,5	+26,7	+116,6	60,5	34.668	28.129	↑

Fonte: Economática®.

Gráfico do IBOV, com os indicadores de Bandas de Bollinger (20 dias e 2 desvios-padrão), Volume (Verde e Laranja) e IFR (azul)



Principais Indicadores Setoriais

	Indicador	Último	Δ Semana	Δ Mês	Δ 12 meses	IFR	Média 21d	Média 200d	Tendência
1	BDRX	13.391	+2,2	+0,2	+14,8	75,5	12.955	12.570	↑
2	ICON	2.947	+7,3	+9,9	-6,8	75,3	2.674	2.853	↑
3	IEEX	90.205	+6,1	+9,4	+15,2	79,1	83.741	83.077	↑
4	IFNC	12.333	+3,5	+7,4	+22,1	72,5	11.568	11.194	↑
5	IMOB	931	+6,3	+11,4	+38,4	74,9	848	824	↑
6	INDX	21.086	+5,0	+5,4	-0,7	79,1	19.781	20.141	↑
7	UTIL	10.644	+6,5	+10,4	+15,1	81,7	9.787	9.473	↑

Fonte: Economática®.



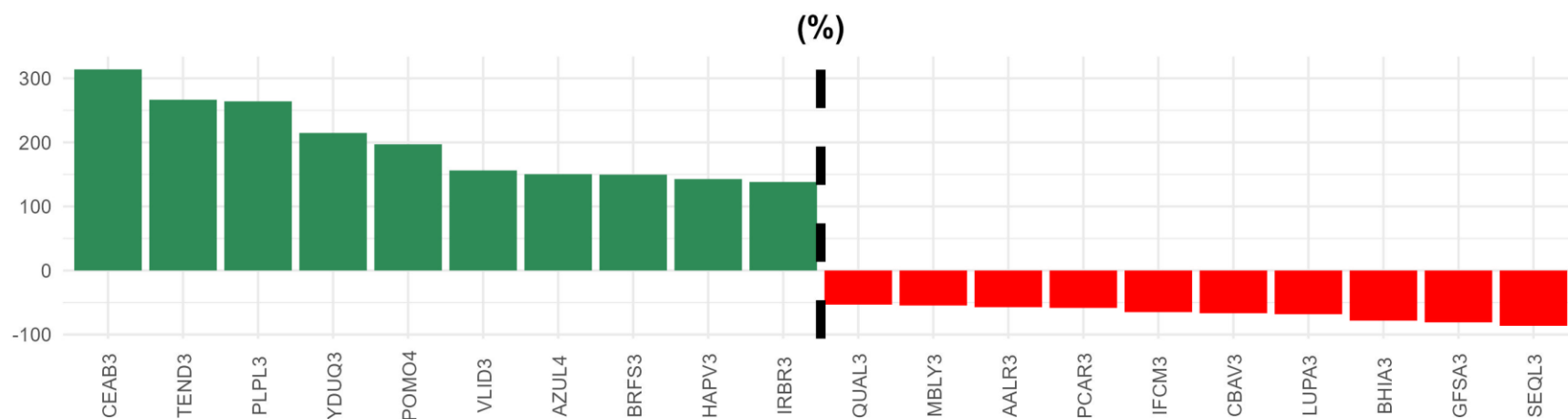
Indicadores | Ações

Retornos Positivos vs. Retornos Negativos

	Ativo	Δ Semana	Ativo	Δ Mês	Ativo	Δ 12 meses	Ativo	Δ Semana	Ativo	Δ Mês	Ativo	Δ 12 meses
1	SBFG3	+35,4	CEAB3	+56,8	CEAB3	+236,0	ENAT3	-1,2	HBSA3	-6,9	MLAS3	-44,1
2	CEAB3	+31,0	GFSA3	+55,9	PLPL3	+217,3	ZAMP3	-1,8	SUZB3	-6,9	PETZ3	-44,8
3	MGLU3	+28,1	PLPL3	+47,5	TEND3	+193,9	TIMS3	-2,0	CLSA3	-7,9	AERI3	-47,9
4	IFCM3	+24,7	SBFG3	+46,3	POMO4	+176,2	JALL3	-2,5	BEEF3	-8,9	AALR3	-49,7
5	GUAR3	+20,5	CMIN3	+41,5	VLID3	+118,9	JHSF3	-2,7	PRI03	-9,0	QUAL3	-51,6
6	GFSA3	+19,8	LJQQ3	+38,4	CMIN3	+99,7	RAPT4	-3,3	ENAT3	-10,1	PCAR3	-51,8
7	BRFS3	+19,7	ALPA4	+33,2	UGPA3	+95,5	LWSA3	-4,8	SMT03	-12,2	IFCM3	-62,6
8	VLID3	+18,6	BRFS3	+28,3	PETR4	+85,9	ONCO3	-5,3	RECV3	-14,3	CBAV3	-64,6
9	CMIN3	+18,2	LOGN3	+28,0	ECOR3	+83,4	HBSA3	-11,5	AMBP3	-18,8	BHIA3	-75,5
10	MLAS3	+17,6	LOGG3	+26,9	IRBR3	+70,4	MBLY3	-42,9	MBLY3	-38,4	SEQL3	-83,2

Fonte: Economática®.

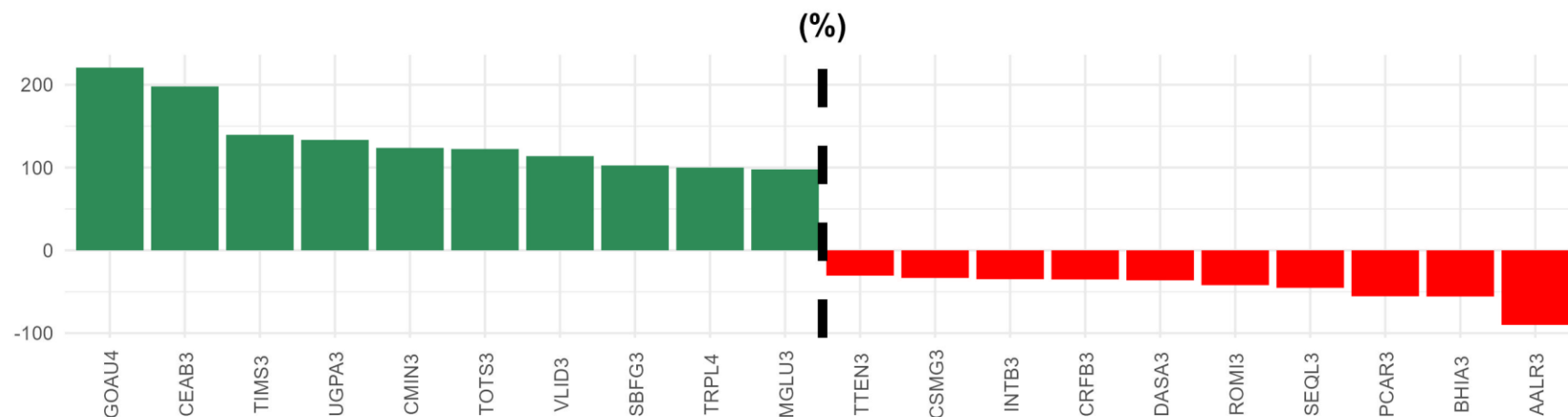
Top 10 maiores retornos desde a mínima das últimas 52 semanas / Top 10 maiores quedas desde a máxima das últimas 52 semanas



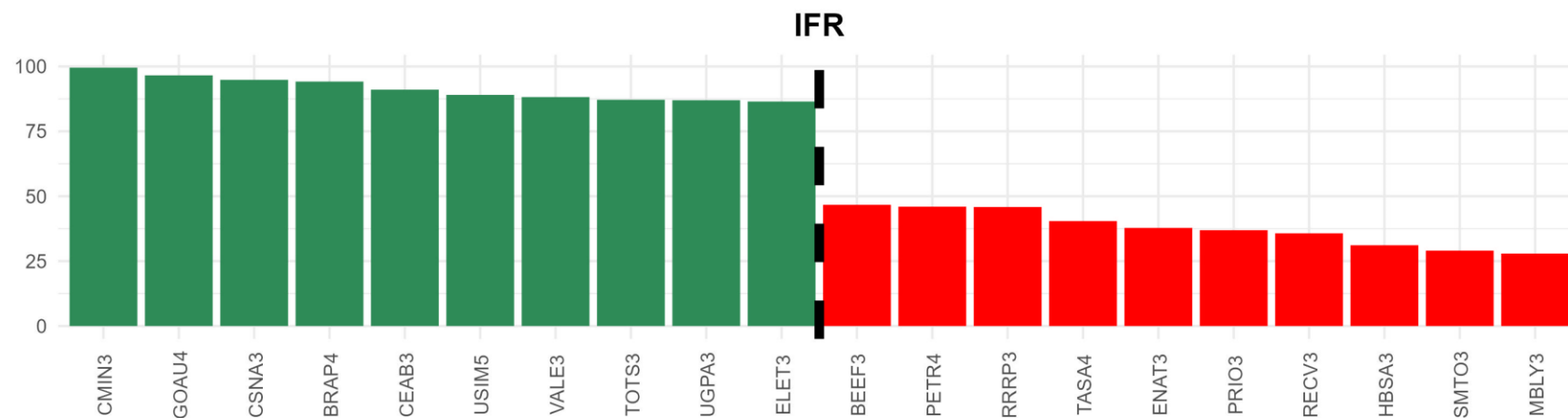


Volume e IFR | Ações

Top 10 Volume Semanal Acima e Abaixo das Últimas 20 Semanas



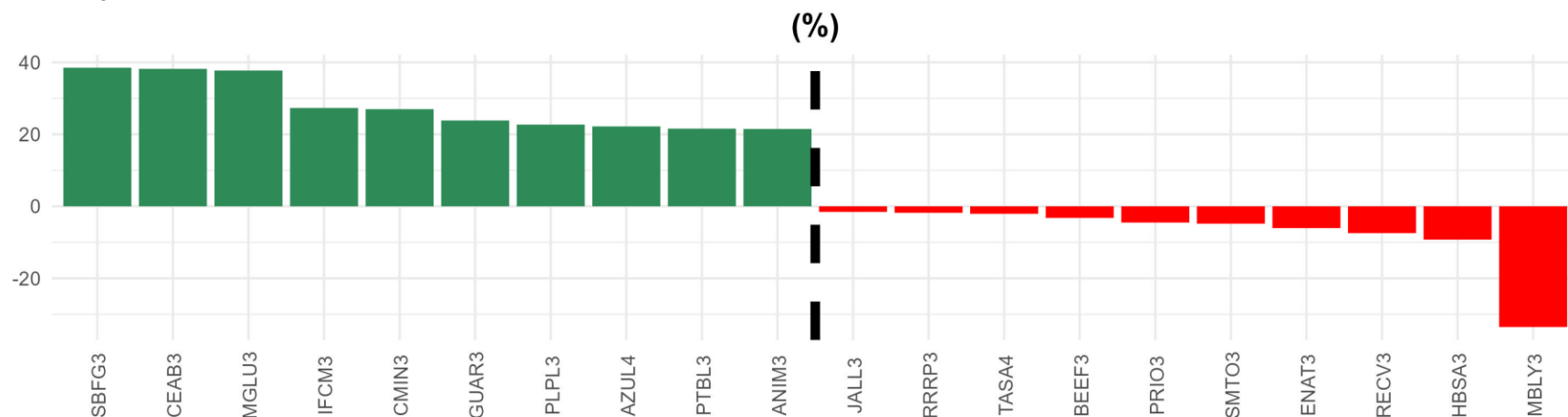
Top 10 Maiores e Menores IFRs



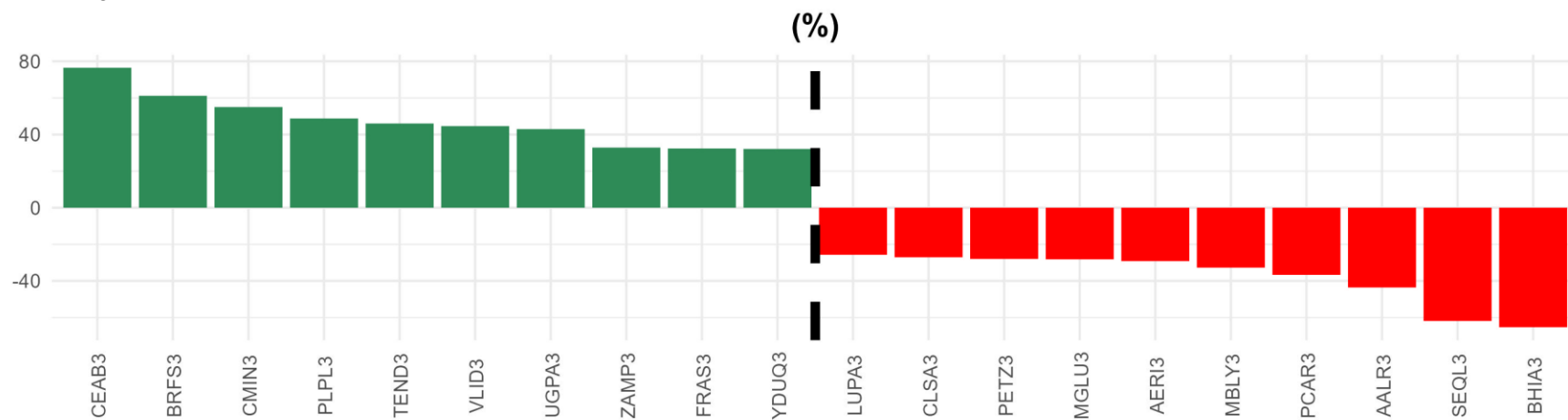


Médias Móveis | Ações

Top 10 Preço Acima e Abaixo das Médias Móveis de 21 Dias



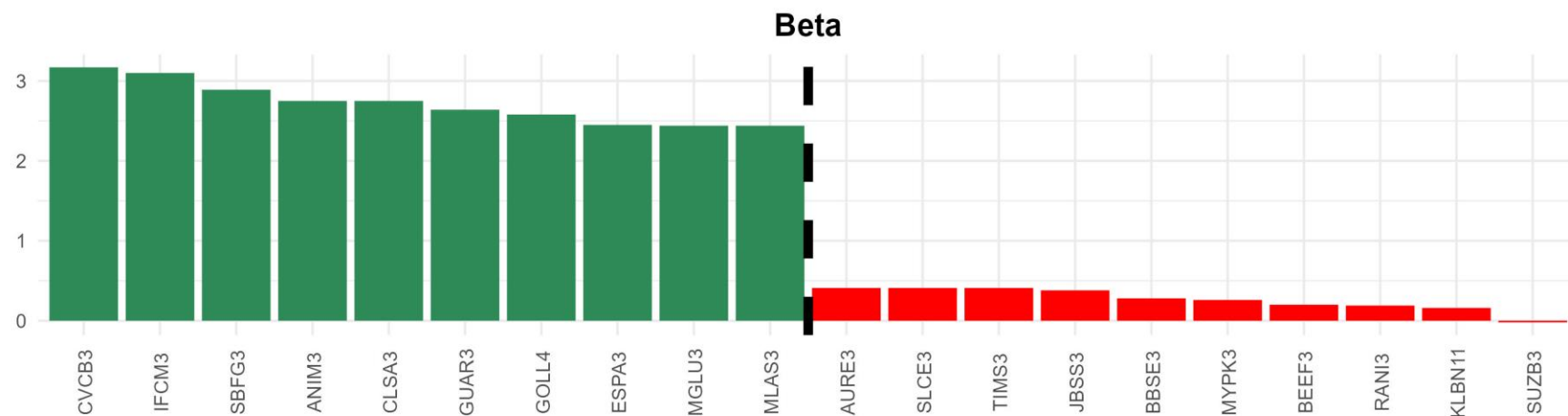
Top 10 Preço Acima e Abaixo das Médias Móveis de 200 Dias



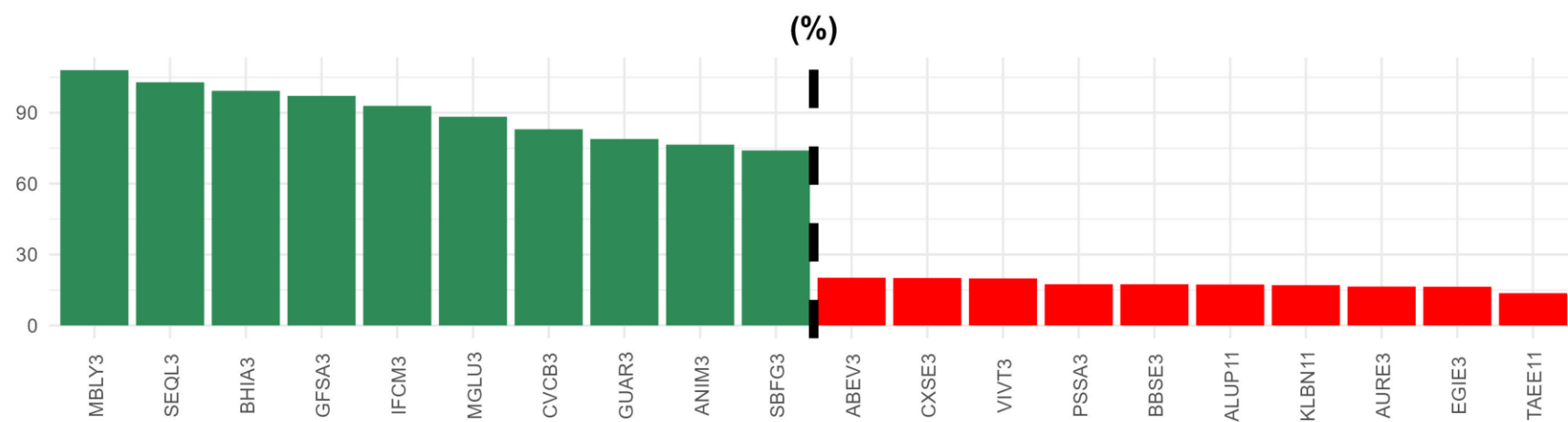


Beta e Volatilidade | Ações

Top 10 Maiores e Menores Betas



Volatilidades dos Últimos 3 meses





Beta e Volatilidade | Ações

Top 30 Ativos com Maior e Menor Volatilidade (3 meses) e dados adicionais de Beta e IFR

	Ativo	Volatilidade (%)	Beta	IFR		Ativo	Volatilidade (%)	Beta	IFR
1	MBLY3	108,03	0,62	27,91	31	RADL3	24,67	0,85	64,81
2	SEQL3	102,91	1,80	62,22	32	FLRY3	24,35	0,70	70,52
3	BHIA3	99,29	1,92	61,36	33	SANB11	24,06	1,02	85,04
4	GFSA3	97,15	0,95	56,04	34	SLCE3	24,05	0,41	64,19
5	IFCM3	92,92	3,10	75,24	35	BRSR6	24,02	0,94	75,48
6	MGLU3	88,33	2,44	76,22	36	SUZB3	23,94	-0,02	54,82
7	CVCB3	83,03	3,17	59,36	37	SBSP3	23,86	0,89	71,57
8	GUAR3	78,91	2,64	72,49	38	GOAU4	23,28	0,77	96,57
9	ANIM3	76,52	2,75	72,54	39	EQTL3	22,98	0,83	71,17
10	SBFG3	74,06	2,89	78,22	40	CPLE6	22,45	0,75	79,79
11	PCAR3	74,02	1,65	71,33	41	CMIG4	22,25	0,74	77,16
12	DASA3	72,94	1,79	52,41	42	BBAS3	22,10	1,01	56,55
13	LOGN3	70,91	1,72	70,57	43	UNIP6	22,03	0,78	69,66
14	MLAS3	69,59	2,44	64,08	44	GGBR4	21,81	0,70	82,44
15	CEAB3	69,51	2,02	91,06	45	TIMS3	21,57	0,41	74,57
16	ZAMP3	69,44	1,83	56,22	46	AESB3	21,51	0,87	61,64
17	TEND3	64,14	2,40	83,40	47	ITUB4	21,36	0,94	80,07
18	SEER3	63,95	1,70	56,62	48	ITSA4	21,13	0,90	84,52
19	LJQQ3	62,96	2,32	71,68	49	CPFE3	20,67	0,81	78,95
20	AALR3	61,84	0,96	65,86	50	JBSS3	20,45	0,38	75,54
21	LUPA3	61,78	1,91	57,50	51	ABEV3	20,21	0,63	75,52
22	AZUL4	60,38	2,05	77,20	52	CXSE3	20,10	0,71	64,00
23	QUAL3	60,35	2,01	49,43	53	VIVT3	19,91	0,64	77,97
24	CLSA3	59,39	2,75	52,69	54	PSSA3	17,45	0,81	74,66
25	GOLL4	59,28	2,58	69,64	55	BBSE3	17,44	0,28	61,98
26	VAMO3	58,40	2,08	74,61	56	ALUP11	17,33	0,41	68,50
27	PLPL3	58,23	1,45	81,61	57	KLBN11	17,06	0,16	70,16
28	BEEF3	57,47	0,20	46,69	58	AURE3	16,47	0,41	73,82
29	AERI3	56,28	2,31	55,81	59	EGIE3	16,40	0,63	74,36
30	PTBL3	56,00	1,99	78,18	60	TAEI11	13,67	0,48	84,90

Fonte: Economática®.

Disclaimer

TC Matrix

O TC Matrix (CNPJ/MF nº 38.297.038/0001-40) é pessoa jurídica registrada como analista de valores mobiliários na Apimec e possui como analista responsável Carlos André Marinho Vieira (CNPI-P EM-1268).

Relatórios

Este relatório de análise foi elaborado pelo TC Matrix, para uso exclusivo do destinatário original, e não pode ser reproduzido, publicado, copiado, divulgado, distribuído, resumido, extraído ou de outra forma referenciado, no todo ou em parte, sem o consentimento prévio e expresso da empresa.

O relatório tem o único objetivo de prover informações que possam auxiliar o investidor a tomar sua própria decisão de investimento, não representando, sob qualquer aspecto, uma oferta ou solicitação de compra ou venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro, ou mesmo aconselhamento legal ou contábil. As informações apresentadas não constituem um objetivo ou estratégia de investimento, uma análise sobre a situação financeira ou necessidade particular de um investidor específico e, portanto, não devem servir como única fonte de informações para a tomada de decisão. O TC Matrix não se responsabiliza por qualquer decisão tomada com base no presente relatório e nem por qualquer perda ou prejuízo.

Este relatório tampouco indica que um objetivo, estratégia de investimento, instrumento financeiro ou recomendação estão automaticamente adequados ao perfil de investidor do destinatário original, suas circunstâncias atuais, ou constituem uma recomendação de caráter pessoal. O perfil de investidor do destinatário original deverá sempre prevalecer, e a sua simetria, verificada. As análises presentes neste relatório representam as opiniões técnicas e pessoais dos analistas, elaboradas de forma independente, inclusive em relação ao TC Matrix, e estão baseadas em informações obtidas de fontes públicas e canais oficiais, consideradas fidedignas na data de sua publicação. Entretanto, ainda que se tenha como premissa a prudência e a verificação das informações aqui contidas, nem o TC Matrix e nem os seus analistas, respondem pela veracidade destas informações.

As opiniões, estimativas e projeções deste relatório são geradas de acordo com as condições econômicas e de mercado disponíveis na data de sua publicação e, portanto, estão naturalmente sujeitas a modificações sem aviso prévio e fora do escopo de controle do TC Matrix. Este relatório tem validade restrita à sua data de publicação, pois eventos futuros também podem impactar nas suas conclusões. O TC Matrix isenta-se da responsabilidade de atualizar, revisar, retificar ou anular este relatório em razão de eventos futuros.

A rentabilidade de valores mobiliários ou instrumentos financeiros pode apresentar variações ao longo do tempo. Desempenhos passados não representam, ou garantem, uma rentabilidade futura. A rentabilidade eventualmente apresentada não é líquida de impostos. Os valores mobiliários e instrumentos financeiros analisados podem fazer parte da carteira pessoal de investimentos dos analistas responsáveis por este relatório, respeitados os prazos de negociação previstos nos incisos III e IV do artigo 13 da Resolução CVM nº 20/2021.

A remuneração dos analistas responsáveis por este relatório é determinada pela diretoria do TC Matrix e não está baseada nas receitas da empresa ou relacionada a quaisquer análises, opiniões, recomendações ou preços de valores mobiliários ou instrumentos financeiros aqui expostos. Os analistas responsáveis por este relatório cumprem todos os requisitos estabelecidos pela Resolução CVM nº 20/2021 e pelo Código de Conduta da APIMEC para o Analista de Valores Mobiliários.

O TC Matrix não possui relações comerciais com a empresa ou grupo econômico emissor do ativo analisado nesse relatório. Eventualmente, outras empresas do Grupo TC podem ter ou pretendem iniciar relações comerciais com a empresa ou grupo econômico cujo ativo é coberto nesse relatório. Por este motivo, os clientes devem estar cientes de eventuais conflitos de interesses que potencialmente possam afetar os objetivos do relatório. O TC Matrix orienta que os clientes devem considerar o relatório apenas como auxiliar na sua própria tomada de decisão de investimento.