

Carteira Quant XP

Modelo Trend Target – Semana 4

Dezembro 2022

EXPERT PASS XP

Para quem é esse produto: Investidores que buscam exposição a renda variável

Para a quarta semana do mês, nenhuma alteração para ambas as carteiras.

Como funciona: A carteira tem balanceamento semanal, onde será vendido e comprador as posições logo na abertura do mercado, independente do preço de abertura do ativo. Os demais ativos que não sofrerem alterações, deve-se manter em carteira.

Carteira: A carteira possui 2 opções de carteira que podem ser trabalhadas em conjunto ou separadas seguindo o ciclo de mercado ou perfil do cliente. **Sharpe Ratio** é a carteira mais agressiva que tem como objetivo maiores retornos, mas possui também maior risco e volatilidade. **Min Vol** já é uma carteira com menor risco e mais voltada para ciclos de correção no mercado.

Estratégia: Baseada em médias móveis e análise Quantitativa, a carteira vai rastrear os ativos com boas chances de valorização dentro do índice Ibovespa.

Carteira Sharpe Ratio

Companhia	Ticker	Setor	Peso	Recomendação
Vale ON NM	VALE3	Minério	20%	Compra
Hypera ON NM	HYPE3	Saúde	21%	Compra
Rumo S.A ON NM	RAIL3	Transporte	20%	Compra
Energisa UNT N2	ENGI11	Elétrica	19%	Compra
Iguatemi S.A UNT N1	IGTI11	Shopping	20%	Compra

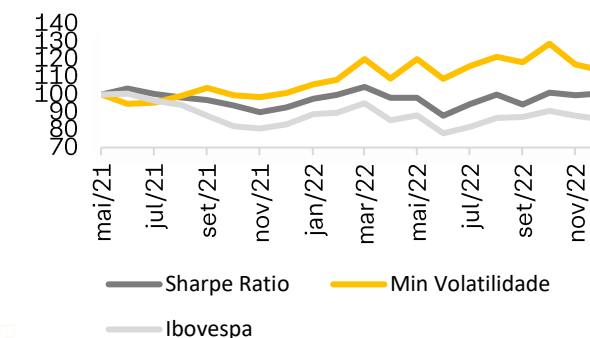
Carteira Min Vol

Companhia	Ticker	Setor	Peso	Recomendação
Weg ON EJ NM	WEGE3	Máquinas	20%	Compra
Energias Br ON NM	ENBR3	Energia	20%	Compra
Santander Br UNT	SANB11	Bancos	20%	Compra
Itaúsa PN N1	ITSA4	Bancos	20%	Compra
TIM ON NM	TIMS3	Comunicação	20%	Compra

Felipe Perígolo

Analista de Ações Quantitativo

Desempenho Carteira Quant



Desempenho

Figura 1: Desempenho da Carteira Target Trend vs. Ibovespa

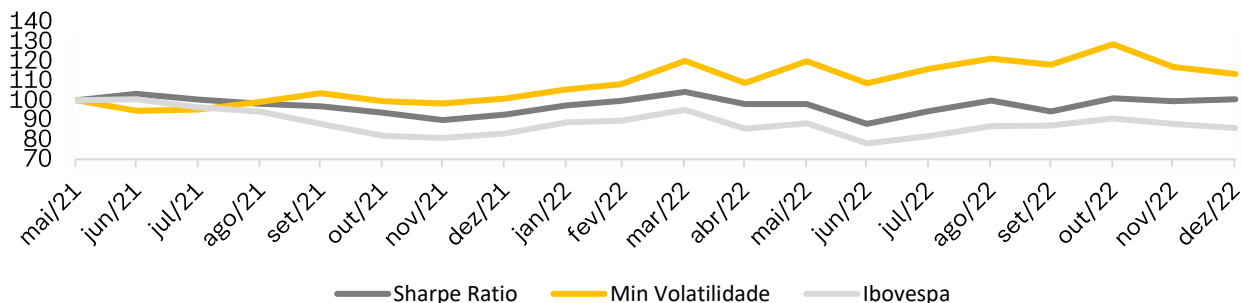
	Desde o Início	YTD	set/21	out/21	nov/21	dez/21	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22
Min Vol	13,40%	0,89%	4,52%	-3,92%	-1,19%	2,44%	4,79%	2,47%	10,88%	-9,28%	10,12%	-9,26%	6,67%	4,52%	-2,51%	8,86%	-9,06%	-3,06%
Sharpe Ratio	0,61%	-4,47%	-1,38%	-3,29%	-4,02%	3,05%	5,18%	2,28%	4,53%	-5,89%	0,00%	-9,03%	7,42%	5,75%	-5,62%	7,12%	-1,54%	1,12%
Ibovespa	-14,22%	3,29%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%	4,09%	-3,06%	-2,48%

Figura 2: Desempenho Novembro

Portfólio		Semana1	Semana2	Semana3	Semana4	Dezembro
Carteira SP	Dezembro	-3,82%	-2,55%	7,49%	0,00%	1,12%
Carteira MV		-4,72%	-3,29%	4,94%	0,00%	-3,06%
Ibovespa		-3,94%	-4,34%	6,65%	0,00%	-2,48%

Figura 3: Desempenho da Carteira Trend Target

Desde o início Junho/21



Disclaimer

INFORMAÇÕES IMPORTANTES

Analista: Felipe Perigolo – CNPI-T: 2702

1) Este relatório de análise foi elaborado pela XP Investimentos CCTVM S.A. (“XP Investimentos ou XP”) de acordo com todas as exigências previstas na Resolução CVM nº 20/2021, tem como objetivo fornecer informações que possam auxiliar o investidor a tomar sua própria decisão de investimento, não constituindo qualquer tipo de oferta ou solicitação de compra e/ou venda de qualquer produto. As informações contidas neste relatório são consideradas válidas na data de sua divulgação e foram obtidas de fontes públicas. A XP Investimentos não se responsabiliza por qualquer decisão tomada pelo cliente com base no presente relatório.

2) Este relatório foi elaborado considerando a classificação de risco dos produtos de modo a gerar resultados de alocação para cada perfil de investidor.

3) O(s) signatário(s) deste relatório declara(m) que as recomendações refletem única e exclusivamente suas análises e opiniões pessoais, que foram produzidas de forma independente, inclusive em relação à XP Investimentos e que estão sujeitas a modificações sem aviso prévio em decorrência de alterações nas condições de mercado, e que sua(s) remuneração(es) é(são) indiretamente influenciada por receitas provenientes dos negócios e operações financeiras realizadas pela XP Investimentos.

4) O analista responsável pelo conteúdo deste relatório e pelo cumprimento da Resolução CVM nº 20/2021 está indicado acima, sendo que, caso constem a indicação de mais um analista no relatório, o responsável será o primeiro analista credenciado a ser mencionado no relatório.

5) Os analistas da XP Investimentos estão obrigados ao cumprimento de todas as regras previstas no Código de Conduta da APIMEC para o Analista de Valores Mobiliários e na Política de Conduta dos Analistas de Valores Mobiliários da XP Investimentos.

6) O atendimento de nossos clientes é realizado por empregados da XP Investimentos ou por agentes autônomos de investimento que desempenham suas atividades por meio da XP, em conformidade com a Resolução CVM nº 16/2021, os quais encontram-se registrados na Associação Nacional das Corretoras e Distribuidoras de Títulos e Valores Mobiliários – ANCORD. O agente autônomo de investimento não pode realizar consultoria, administração ou gestão de patrimônio de clientes, devendo atuar como intermediário e solicitar autorização prévia do cliente para a realização de qualquer operação no mercado de capitais.

7) Os produtos apresentados neste relatório podem não ser adequados para todos os tipos de cliente. Antes de qualquer decisão, os clientes deverão realizar o processo de suitability e confirmar se os produtos apresentados são indicados para o seu perfil de investidor. Este material não sugere qualquer alteração de carteira, mas somente orientação sobre produtos adequados a determinado perfil de investidor.

8) A rentabilidade de produtos financeiros pode apresentar variações e seu preço ou valor pode aumentar ou diminuir num curto espaço de tempo. Os desempenhos anteriores não são necessariamente indicativos de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. As informações presentes neste material são baseadas em simulações e os resultados reais poderão ser significativamente diferentes.

9) Este relatório é destinado à circulação exclusiva para a rede de relacionamento da XP Investimentos, incluindo agentes autônomos da XP e clientes da XP, podendo também ser divulgado no site da XP. Fica proibida sua reprodução ou redistribuição para qualquer pessoa, no todo ou em parte, qualquer que seja o propósito, sem o prévio consentimento expresso da XP Investimentos.

10) SAC. 0800 772 0202. A Ouvidoria da XP Investimentos tem a missão de servir de canal de contato sempre que os clientes que não se sentirem satisfeitos com as soluções dadas pela empresa aos seus problemas. O contato pode ser realizado por meio do telefone: 0800-722-3730.

11) O custo da operação e a política de cobrança estão definidos nas tabelas de custos operacionais disponibilizadas no site da XP Investimentos: www.xpi.com.br.


12) A XP Investimentos se exime de qualquer responsabilidade por quaisquer prejuízos, diretos ou indiretos, que venham a decorrer da utilização deste relatório ou seu conteúdo.

13) A Avaliação Técnica e a Avaliação de Fundamentos seguem diferentes metodologias de análise. A Análise Técnica é executada seguindo conceitos como tendência, suporte, resistência, candles, volumes, médias móveis entre outros. Já a Análise Fundamentalista utiliza como informação os resultados divulgados pelas companhias emissoras e suas projeções. Desta forma, as opiniões dos Analistas Fundamentalistas, que buscam os melhores retornos dadas as condições de mercado, o cenário macroeconômico e os eventos específicos da empresa e do setor, podem divergir das opiniões dos Analistas Técnicos, que visam identificar os movimentos mais prováveis dos preços dos ativos, com utilização de “stops” para limitar as possíveis perdas.

14) Para fins de verificação da adequação do perfil do investidor aos serviços e produtos de investimento oferecidos pela XP Investimentos, utilizamos a metodologia de adequação dos produtos por portfólio, nos termos das Regras e Procedimentos ANBIMA de Suitability nº 01 e do Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Distribuição de Produtos de Investimento. Essa metodologia consiste em atribuir uma pontuação máxima de risco para cada perfil de investidor (conservador, moderado e agressivo), bem como uma pontuação de risco para cada um dos produtos oferecidos pela XP Investimentos, de modo que todos os clientes possam ter acesso a todos os produtos, desde que dentro das quantidades e limites da pontuação de risco definidas para o seu perfil. Antes de aplicar nos produtos e/ou contratar os serviços objeto deste material, é importante que você verifique se a sua pontuação de risco atual comporta a aplicação nos produtos e/ou a contratação dos serviços em questão, bem como se há limitações de volume, concentração e/ou quantidade para a aplicação desejada. Você pode consultar essas informações diretamente no momento da transmissão da sua ordem ou, ainda, consultando o risco geral da sua carteira na tela de carteira (Visão Risco). Caso a sua pontuação de risco atual não comporte a aplicação/contratação pretendida, ou caso existam limitações em relação à quantidade e/ou volume financeiro para a referida aplicação/contratação, isto significa que, com base na composição atual da sua carteira, esta aplicação/contratação não está adequada ao seu perfil. Em caso de dúvidas sobre o processo de adequação dos produtos oferecidos pela XP Investimentos ao seu perfil de investidor, consulte o FAQ. A duração recomendada para o investimento é de curto prazo e o patrimônio do cliente não está garantido neste tipo de produto. As condições de mercado, mudanças climáticas e o cenário macroeconômico podem afetar o desempenho do investimento.

EXPERT PASS

ESTRATÉGIA


Felipe Perígolo
Analista CNPI-T