INFORMATIVO ***ABRIL 2024*** Download

Copacabana Quantitativo

Multimercado com estratégia quantitativa que opera índice futuro com objetivo de superar a variação do CDI.

Política de investimento

Multimercado que opera estratégia quantitativa desenvolvida pela gestora usando derivativos, com o objetivo de superar o CDI.

Patrimônio	Cota	Mês	Ano	6M	12M	Início
11.022M	1,3384	1,26%	10,35%	7,07%	22,43%	33,84%
			% CDI			
		142%	293%	131%	182%	144%

Última atualização: 30/04/2024

Estratégia de Investimento

Fundo de baixa volatilidade média com alvo em 150% do CDI. Estratégia quantitativa com índice futuro do Bovespa. O fundo mantém operações abertas por prazo indeterminado, podendo variar sua volatilidade em momentos de stress ou euforia do mercado.

Público Alvo

O Fundo é destinado a investidores em geral.

Imposto de renda

O Imposto de Renda incidirá semestralmente, no último dia útil de maio e novembro de cada ano, à alíquota de 15% sobre os rendimentos produzidos no período. Adicionalmente, no resgate das cotas, será aplicada alíquota complementar de acordo com o prazo de aplicação, conforme tabela regressiva. Contudo, não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo.

IOF

Os resgates ocorridos em um prazo inferior a 30 dias da data de aplicação no fundo sofrerão incidência do IOF, conforme tabela regressiva da legislação em vigor.

Tipo Anbima:

Multimercados Livre

Início do fundo: 29/07/2022
Horário de Movimentação: até às 15h00
Taxa Administrativa máxima + Custódia (a.a): 1,0%
CNPJ do fundo: 45.218.073/0001-92
Administrador: TRUSTEE DTVM LTDA
Taxa de Performance: conforme tabela anexa

Valores Mínimos (R$)

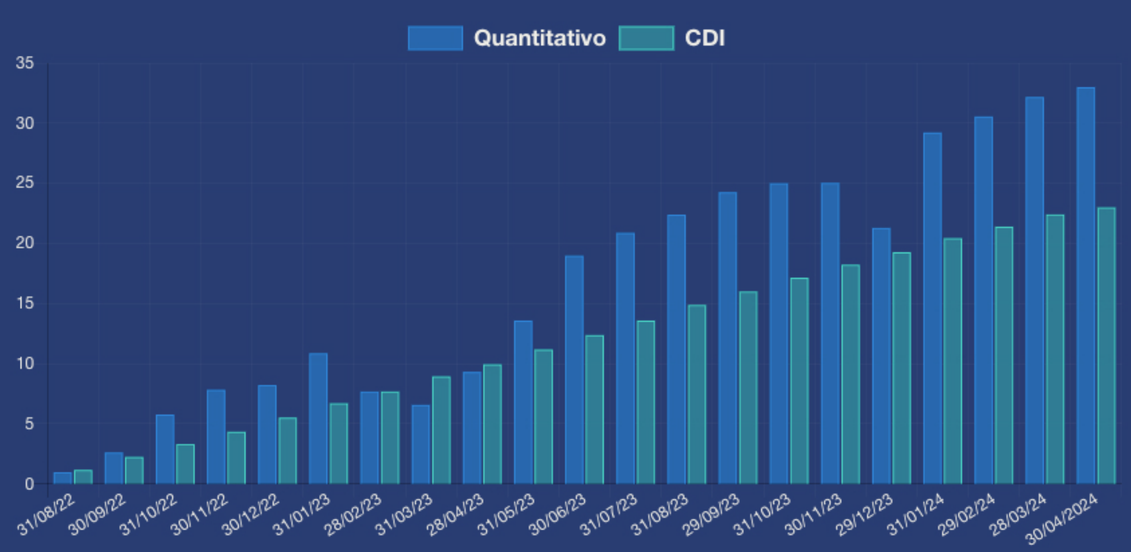
Aplicação inicial: R$ 50.000,00
Aplicações Adicionais: R$ 10.000,00
Resgate Mínimo: R$ 1.000,00
Resgate Máximo Diário: R$ 50.000,00
Saldo Mínimo: R$ 10.000,00

Conversões de Cotas

Aplicação: D+0
Resgate: D+1
Crédito: D+4
Tipo de Cota: Fechamento

Gráfico de rentabilidade

Copacabana Quantitativo FIM (%)



Volatilidade

2022 a 2024	12M
8,83%	6.50%

PL M R$

30/04/2024
11.022

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2024	Copacabana Quantitativo FIM % do CDI	6,55 678	1,03 128	1,24 149	1,26 142									10,35 293
2023	Copacabana Quantitativo FIM % do CDI	2,45 218	-2,87 -312	-1,03 -88	2,58 281	3,91 348	4,75 443	1,59 149	1,25 109	1,53 157	0,60 60	0,03 3	-3,00 -335	12,08 92,63
2022	Copacabana Quantitativo FIM % do CDI								0,96 82	1,64 153	3,08 302	1,95 191	0,35 32	8,21 149

Comentários do Gestor

Mês atual (Abril 2024)

O mercado anda lateralizado, ameaçando romper pra cima e depois ameaçando romper pra baixo e frustrando os movimentos. Como falamos nos últimos meses, o fundo operou com volatilidade super baixa, de 1,3% e mesmo assim entregou performance próxima da meta. Seguimos esperando movimentos de maior volatilidade, onde devemos obter ainda melhores performances.