

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
10.968M	1,2503	0,00%	10,35%	7,04%	17,82%	33,84%
% CDI						
		-1%	235%	132%	149%	138%

Última atualização: 31/05/2024

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
8,41%	5,47%

PL M R\$

31/05/2024
10,968

		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	0,00 -1								10,35 235
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 93
2022	Copacabana Quantitativo FIM % do CDI								0,96 82	1,64 153	3,08 302	1,95 191	0,35 32	8,21 149

RENTABILIDADE DESDE O INÍCIO DO FUNDO (AGO/22): 33,84%, REPRESENTANDO 138% DO CDI

Comentários do Gestor

Maio de 2024

O mercado se manteve lateralizado por boa parte do mês, mas na última semana rompeu para baixo e iniciou um movimento mais volátil. Este movimento acabou reduzindo a rentabilidade do mês e aumentando as posições acumuladas do fundo que, ainda assim, permanece com exposição comedida. Esperamos que este movimento se acentue e que isto dê força para que o fundo tenha uma performance melhor no período seguinte.