INFORMATIVO *SETEMBRO 2024*

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
18.206	1,4178	1,97%	16,90%	7,26%	14,10%	41,78%
			% CDI			
		236%	212%	139%	128%	145%

Última atualização: 30/09/2024

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): 0,99%
CNPJ do fundo: 45.218.073/0001-92
Administrador: TRUSTEE DTVM LTDA
Taxa de Performance: conforme tabela anexa

Valores Mínimos (R$)

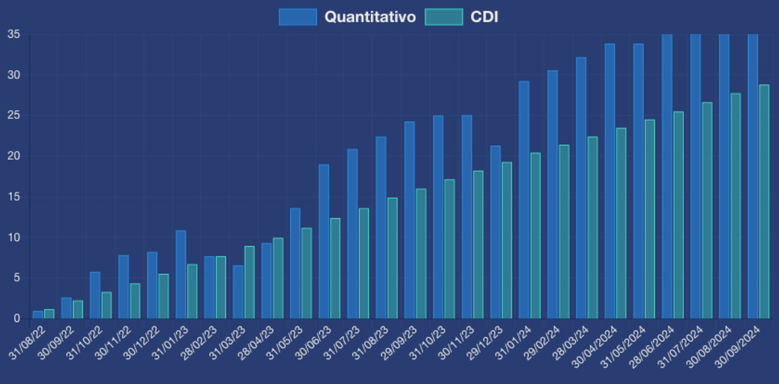
Aplicação inicial: R$ 50.000,00
Aplicações Adicionais: R$ 10.000,00
Resgate Mínimo: R$ 1.000,00
Resgate Máximo Diário: R$ 250.000,00
Saldo Mínimo: R$ 10.000,00

Conversões de Cotas

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

Gráfico de rentabilidade

Copacabana Quantitativo FIM (%)



RENTABILIDADE

DESDE INÍCIO	12M
41,78%	14,10%

VOLATILIDADE

DESDE INÍCIO	12M
7,92%	5,67%

PL M R$

30/09/2024: 18,206

		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	1,56 198	1,72 190	0,57 65	1,97 236				16,90 212
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): 41,78%, REPRESENTANDO 145% DO CDI

RENTABILIDADE DESDE O INÍCIO DO FUNDO (AGO/22): 39,05%, REPRESENTANDO 141% DO CDI

Comentários do Gestor

Setembro de 2024

A primeira quinzena do mês foi muito positiva, já que permitiu o fechamento de todas as operações no movimento de alta do mercado. Já na segunda quinzena, o mercado continuou seu movimento de alta e começamos a abrir novas posições que aguardavam um retorno nos preços pra serem realizadas. O mercado até retornou um pouco e conseguiu nos deixar novamente com resultado acima do nosso alvo, mas no fim do último dia do mês houve um movimento atípico que fez com que a nossa marcação a mercado fosse prejudicada, transferindo parte desse resultado para o dia seguinte e por consequência para o mês seguinte. Lembro que essa volatilidade no resultado é normal e desejada já que colabora pra um resultado melhor no longo prazo.

Confira as cartas do gestor →