

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
18.591	1,4274	-0,32%	17,69%	6,84%	14,16%	42,74%
% CDI						
		-40%	180%	133%	131%	138%

Última atualização: 29/11/2024

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
42,74%	14,16%

VOLATILIDADE

DESDE INÍCIO	12M
7,78%	5,69%

PL M R\$

29/11/2024: 18,591

	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	1,00 107	-0,32 -40		17,69 180
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): 42,74%, REPRESENTANDO 138% DO CDI

Comentários do Gestor

Novembro de 2024

Em Novembro tivemos o primeiro mês negativo de 2024 com -0,32%. Acreditamos que estamos muito bem posicionados para o momento do mercado e aumentamos a volatilidade do fundo em Dezembro pra capturar uma alta mais significativa. Apesar dos últimos meses estarem relativamente fracos, o resultado do ano está em +17,69% e nossa expectativa é de fechar o ano próximo dos 20%.

Confira as cartas do gestor

