

OBJETIVO E ESTRATÉGIA

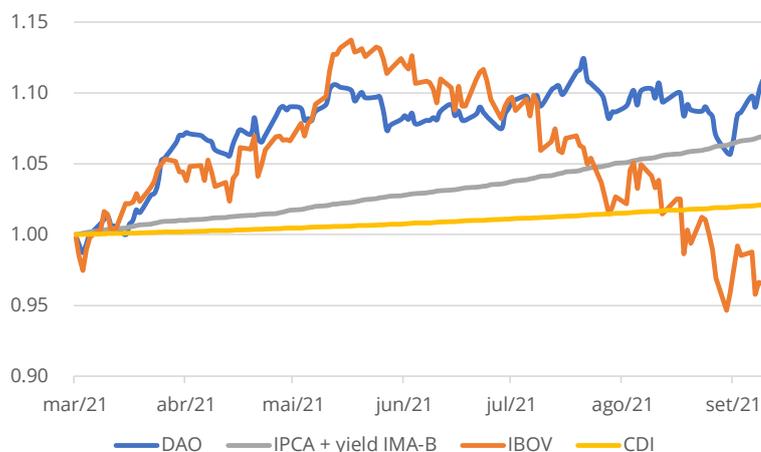
O fundo busca retornos através de operações no mercado acionário, utilizando-se de uma metodologia sistemática e baseada em fatores de risco para a seleção de ativos e construção do portfólio. A escolha de ações e a definição do tamanho das posições segue um rigoroso processo de controle de risco, visando minimização de volatilidade e perdas potenciais.

RENTABILIDADE MENSAL

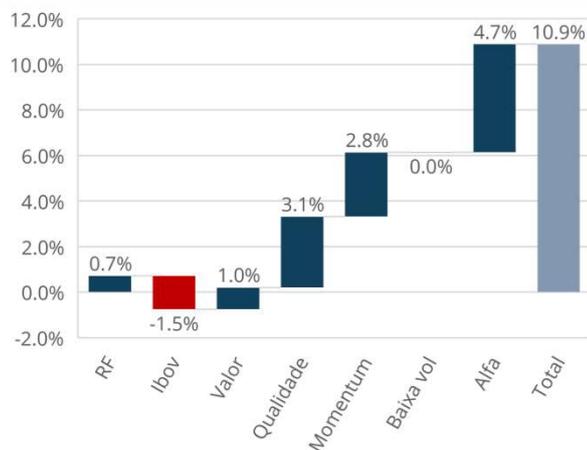
	JAN	FEV	MAR*	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO*	INÍCIO
2021														
DAO			1.3%	4.6%	3.0%	-0.9%	0.8%	0.5%	1.1%				10.9%	10.9%
IPCA + yield IMA-B			0.4%	0.8%	0.8%	1.0%	1.1%	1.3%	1.4%				6.9%	6.9%
IBOVESPA			1.4%	1.9%	6.2%	0.5%	-3.9%	-2.5%	-6.6%				-3.5%	-3.5%
CDI			0.1%	0.2%	0.3%	0.3%	0.4%	0.4%	0.4%				2.1%	2.1%

* A partir do início do fundo em 22/3/2021

GRÁFICO DA PERFORMANCE



ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE (DESDE O INÍCIO)



COMPOSIÇÃO SETORIAL

Setores long		Setores short	
Energia elétrica	19.3%	Construção civil	-6.7%
Alimentos processados	16.6%	Comércio	-5.9%
Madeira e papel	14.4%	Diversos	-4.1%
Mineração	7.8%	Transporte	-2.3%
Serviços médicos	7.1%	Serviços	-2.1%
Outros	34.3%	Outros	-8.8%
Total long	99.6%	Total short	-29.8%

ESTADÍSTICAS DESDE O INÍCIO

	DAO	IBOV
Volatilidade anualizada	9.98%	17.90%
Melhor mês	4.6%	6.2%
Pior mês	-0.9%	-6.6%
Meses positivos	6	
Meses negativos	1	
Meses acima do benchmark	3	
Meses abaixo do benchmark	4	
Patrimônio líquido	R\$24.4MM	
Patrimônio médio 12 meses	R\$17,8MM	

INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

Data de início: 22/3/2021

Aplicação mínima: R\$500,00

Movimentação mínima: R\$500,00

Saldo mínimo: R\$500,00

Cota de aplicação: D+1

Cota de resgate: D+30

Pagamento do resgate: D+32

Tributação: alíquota de 15%, exclusivamente no resgate de cotas

Taxa de administração: 2% a.a.

Taxa de performance: 20% sobre o que exceder o IPCA + yield do IMA-B

Gestor: DAO Capital Ltda

Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros S/A DTVM

Custodiante: Banco BTG Pactual S/A

Auditor: Ernst & Young

Público-alvo: Investidores em geral

Categoria Anbima: Multimercado Long & Short Direcional

CNPJ do fundo: 40.920.066/0001-14

Para mais informações, favor contactar:

ri@daocapital.com.br

(11) 3884-1888

www.daocapital.com.br

Este fundo é supervisionado e fiscalizado pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM (Serviço de atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br). Os rendimentos serão tributados no momento do resgate, à alíquota de 15%. O portfólio do fundo terá exposição local, com posições em ações que variam em média de 70% do patrimônio líquido do fundo, distribuídos em estratégias Long and Short e Direcional. Tipo Anbima: MULTIMERCADOS LONG AND SHORT DIRECIONAL - Fundos que são baseados nas estratégias preponderantes adotadas e suportadas pelo processo de investimento adotado pelo gestor como forma de atingir os objetivos e executar a política de investimentos dos Fundos. Fundos que não possuem obrigatoriamente o compromisso de concentração em nenhuma estratégia específica. Início do fundo em: 22/03/2021. Taxa de Administração máx.: 2,00%. Taxa de Performance: 20% do que exceder 100% do IPCA + Yield IMA-B. Fonte de dados do material: DAO Capital Ltda. Leia a lâmina de informações essenciais e o regulamento antes de investir. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Dúvidas, sugestões e reclamações, fale conosco através do (11) 3884-1888, dias úteis das 09Hs às 18Hs, ou através do nosso site (www.daocapital.com.br). Ouvidoria DAO Capital (11) 3884-1888.