DAO Defender Long Short Icatu Prev FICFIM

Fevereiro/2024

OBJETIVO E ESTRATÉGIA

O DAO Defender Long Short Icatu Prev é um fundo multimercado que busca retornos através de operações compradas e vendidas 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 zero correlação com o Ibovespa. volatilidade anualizada de aproximadamente 6.5% e minimização de perdas potenciais.

RENTABILIDADE MENSAL*

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INÍCIO
2024	DAO	2.1%	-1.4%											0.7%	9.6%
	CDI	1.0%	0.8%											1.8%	17.8%
2023	DAO	-0.6%	1.7%	-0.8%	-0.9%	-1.0%	1.5%	-0.6%	2.1%	2.2%	-0.3%	0.8%	1.3%	5.3%	8.9%
	CDI	1.2%	0.9%	1.2%	0.9%	1.1%	1.1%	1.1%	1.1%	1.0%	1.0%	0.9%	0.9%	13.0%	15.7%
2022	DAO										-1.1%	3.0%	1.4%	3.4%	3.4%
	CDI										0.2%	1.0%	1.1%	2.3%	2.3%

^{*} Outubro/2022: a partir do início do fundo em 25/10/2022

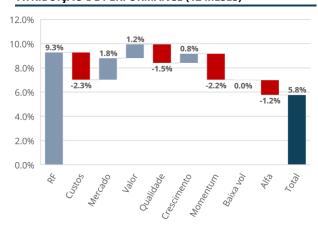
GRÁFICO DA PERFORMANCE



COMPOSIÇÃO SETORIAL

Setores long		Setores short	
Energia elétrica	10.6%	Varejo	-6.6%
Petróleo e gás	10.0%	Programas e serviços	-3.6%
Intermediários financeiros	7.3%	Serviços médicos	-3.3%
Material de transporte	4.6%	Construção civil	-2.6%
Transporte	4.5%	Diversos	-2.6%
Outros	22.6%	Outros	-16.8%
Total long	59.6%	Total short	-35.5%

ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE (12 MESES)



ESTATÍSTICAS DESDE O INÍCIO

	DAO	CDI
Volatilidade anualizada	6.3%	0.1%
Melhor mês	3.0%	1.2%
Pior mês	0.0%	0.0%
Meses positivos	9	17
Meses negativos	8	0
Meses acima do benchmark	8	
Meses abaixo do benchmark	9	
Patrimônio líquido	R\$2.5MM	
Patrimônio médio 12 meses	R\$2.2MM	
Patrimônio da estratégia	R\$2.5MM	

INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

Data de inicio: 16/9/2022 Aplicação minima: R\$500,00 Movimentação mínima: R\$500,00

Saldo mínimo: R\$500,00 Cota de aplicação: D+1 Cota de resgate: D+6 Pagamento do resgate: D+8

Tributação: Regime Progressivo ou Regressivo, à escolha do cliente

Taxa de administração: 2% a.a.

Taxa de performance: 20% sobre o que exceder o CDI

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: Previdência Multimercado Livre

CNPJ do fundo: 46.415.130/0001-96

Para mais informações, favor contatar:

ri@daocapital.com.br

(11) 3849-6841

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 será composto de posições long e short em ações locais, com exposição líquida aproximada de 70% do patrimônio líquido. 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 9h às 18h, ou através do nosso site (www.daocapital.com.br). Ouvidoria DAO