DAO CAPITAL

DAO Defender Long Short FICFIM

Fevereiro/2024

OBJETIVO E ESTRATÉGIA

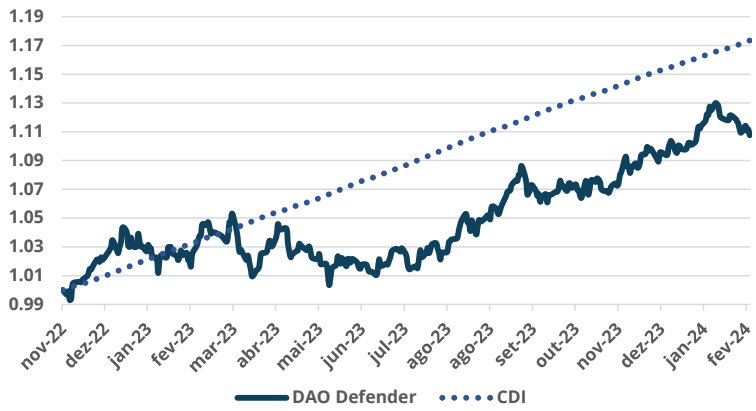
O DAO Defender Long Short é um fundo multimercado que busca retornos através de operações compradas e vendidas no mercado acionário, utilizando-se de uma metodologia sistemática e baseada em fatores de risco para a seleção de ativos e construção do portfólio. A escolha de ações e a definição do tamanho 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 *

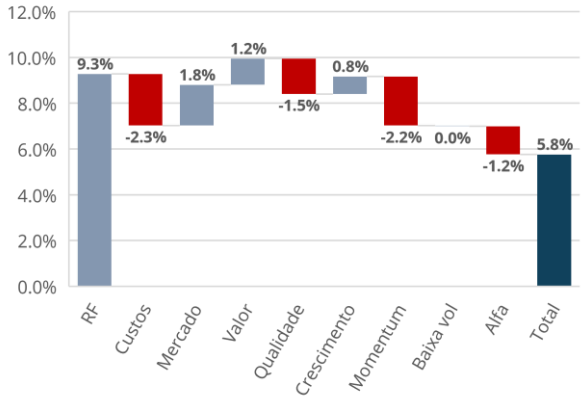
		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INÍCIO
2024	**DAO**	**2.4%**	**-1.2%**											**1.1%**	**10.8%**
	CDI	1.0%	0.8%											1.8%	17.3%
2023	**DAO**	**-0.9%**	**1.6%**	**-0.7%**	**-0.8%**	**-0.7%**	**1.4%**	**-0.3%**	**2.3%**	**2.3%**	**-0.3%**	**1.0%**	**1.4%**	**6.3%**	**9.6%**
	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%	15.2%
2022	**DAO**											**2.0%**	**1.1%**	**3.0%**	**3.0%**
	CDI											0.9%	1.1%	1.9%	1.9%

** Novembro/2022: a partir do início do fundo em 4/11/2022*

GRÁFICO DA PERFORMANCE



ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE (12 MESES)



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%**

ESTATÍSTICAS DESDE O INÍCIO

	DAO	CDI
Volatilidade anualizada	6.3%	0.1%
Melhor mês	2.0%	1.2%
Pior mês	0.0%	0.9%
Meses positivos	9	15
Meses negativos	6	0
Meses acima do benchmark	8	
Meses abaixo do benchmark	7	
Patrimônio líquido	R$7.2MM	
Patrimônio médio 12 meses	R$7.2MM	
Patrimônio da estratégia	R$7.2MM	

INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

Data de inicio: 4/11/2022
Aplicação minima: R$500,00
Movimentação mínima: R$500,00
Saldo mínimo: R$500,00
Cota de aplicação: D+1
Cota de resgate: D+30
Pagamento do resgate: D+32
Tributação: Long prazo
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: Long & short direcional
CNPJ do fundo: 47.812.154/0001-41

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