DAO CAPITAL

DAO Multifactor Long Biased FIC FIM

Fevereiro/2024

OBJETIVO E ESTRATÉGIA

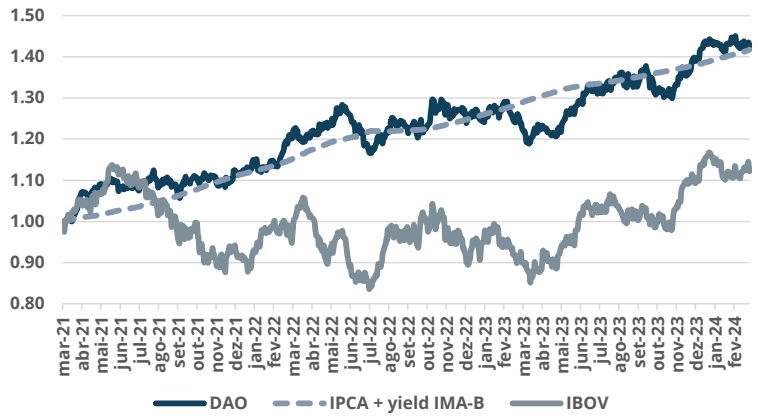
O DAO Multifactor é um fundo Long Biased que busca retornos através de operações no mercado acionário, utilizando-se de uma metodologia sistemática e baseada em fatores de risco para a seleção de ativos e construção do portfólio. A escolha de ações e a definição do tamanho das posições segue um rigoroso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

RENTABILIDADE MENSAL *

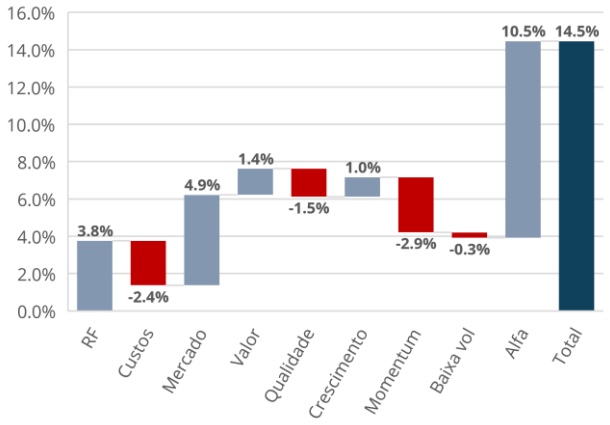
		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INÍCIO
2024	**DAO**	**-0.3%**	**-1.0%**											**-1.3%**	**42.4%**
	IPCA + yield IMA-B	1.0%	1.0%											2.0%	41.8%
	IBOVESPA	-4.8%	1.0%											-3.8%	12.2%
	CDI	1.0%	0.8%											1.8%	34.5%
2023	**DAO**	**0.4%**	**-2.2%**	**-2.3%**	**0.0%**	**3.7%**	**5.7%**	**0.3%**	**-0.8%**	**1.7%**	**-3.7%**	**6.2%**	**4.6%**	**13.8%**	**44.3%**
	IPCA + yield IMA-B	1.1%	1.0%	1.4%	1.0%	1.0%	0.5%	0.5%	0.7%	0.7%	0.7%	0.7%	0.9%	10.7%	39.0%
	IBOVESPA	3.4%	-7.5%	-2.9%	2.5%	3.7%	9.0%	3.3%	-5.1%	0.7%	-2.9%	12.5%	5.4%	22.3%	16.7%
	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%	32.1%
2022	**DAO**	**0.3%**	**2.3%**	**3.9%**	**2.0%**	**3.9%**	**-4.4%**	**-0.5%**	**2.5%**	**-2.2%**	**5.0%**	**-0.1%**	**-0.2%**	**12.7%**	**26.8%**
	IPCA + yield IMA-B	1.1%	1.2%	1.9%	1.6%	1.3%	1.1%	0.7%	0.1%	0.2%	0.6%	1.0%	1.1%	12.4%	25.5%
	IBOVESPA	7.0%	0.9%	6.1%	-10.1%	3.2%	-11.5%	4.7%	6.2%	0.5%	5.5%	-3.1%	-2.4%	4.7%	-4.6%
	CDI	0.8%	0.8%	0.9%	0.8%	1.0%	1.0%	1.0%	1.2%	1.1%	1.0%	1.0%	1.1%	12.4%	16.8%
2021	**DAO**			**1.3%**	**4.6%**	**3.0%**	**-0.9%**	**0.8%**	**0.5%**	**1.1%**	**0.8%**	**-2.5%**	**3.3%**	**12.5%**	**12.5%**
	IPCA + yield IMA-B			0.4%	0.8%	0.8%	1.0%	1.1%	1.3%	1.4%	1.6%	1.5%	1.4%	11.7%	11.7%
	IBOVESPA			1.4%	1.9%	6.2%	0.5%	-3.9%	-2.5%	-6.6%	-6.7%	-1.5%	2.9%	-8.8%	-8.8%
	CDI			0.1%	0.2%	0.3%	0.3%	0.4%	0.4%	0.4%	0.5%	0.6%	0.7%	4.0%	4.0%

** Março/2021: a partir do início do fundo em 22/3/2021*

GRÁFICO DA PERFORMANCE



ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE (12 MESES)



COMPOSIÇÃO SETORIAL

Setores long		Setores short	
Petróleo e gás	16.2%	Varejo	-4.8%
Energia elétrica	15.0%	Programas e serviços	-3.0%
Intermediários financeiros	12.3%	Serviços médicos	-2.9%
Material de transporte	7.7%	Construção civil	-2.2%
Transporte	7.1%	Construção e engenhar	-2.1%
Outros	37.8%	Outros	-13.5%
Total long	**96.1%**	**Total short**	**-28.5%**

ESTATÍSTICAS DESDE O INÍCIO

	DAO	IBOV
Volatilidade anualizada	10.4%	18.8%
Melhor mês	5.7%	9.0%
Pior mês	-4.4%	-11.5%
Meses positivos	22	22
Meses negativos	14	14
Meses acima do benchmark	15	
Meses abaixo do benchmark	21	
Patrimônio líquido	R$96.2MM	
Patrimônio médio 12 meses	R$102.2MM	
Patrimônio da estratégia	R$96.3MM	

INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

Data de inicio: 22/3/2021
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: 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 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 Capital (11) 3884-1888.