

OBJETIVO

Fundo sistemático que busca capturar prêmio de risco em fatores long short de ações, com descorrelação vs classes de ativos. Carteira diversificada com mais de 150 posições, entre compradas e vendidas, visando volatilidade próxima de 8% a.a.

PÚBLICO-ALVO

Investidores em geral, conforme regulamentação expedida pela CVM, que tenham horizonte de investimento de médio e longo prazo.

CARACTERÍSTICAS

DATA DE INÍCIO:

29/07/2022

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO:

2,0% ao ano

TAXA DE PERFORMANCE:

20% sobre o que exceder o CDI

APLICAÇÃO MÍNIMA:

R\$ 500

MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA:

R\$ 100

SALDO MÍNIMO:

R\$ 500

COTA DE APLICAÇÃO:

D+1

COTA DE RESGATE:

D+14 úteis

LIQUIDAÇÃO DE RESGATE:

D+2 úteis da cotização

TRIBUTAÇÃO:

Renda Variável

CLASSIFICAÇÃO CVM:

Multimercado

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA:

Multimercado Long and Short Direcional

CÓDIGO ANBIMA:

663743

CNPJ:

46.929.688/0001-90

GESTOR:

Bayes Capital Management e AZ Quest Investimentos

ADMINISTRADOR:

BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM

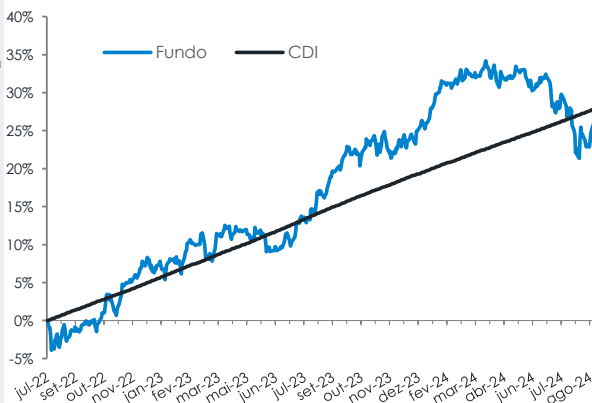
CUSTODIANTE:

Banco BTG Pactual S.A.

AUDITOR:

EY

PERFORMANCE ACUMULADA



MATRIZ DE CORRELAÇÃO ITD

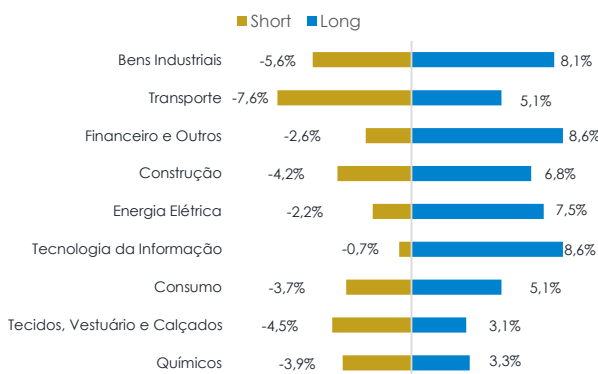
	AZ QUEST BAYES LS	DÓLAR	IBOVESPA	IHFA	IMA-B
AZ QUEST BAYES LS	1,00				
DÓLAR	0,16	1,00			
IBOVESPA	-0,22	-0,43	1,00		
IHFA	-0,24	-0,41	0,64	1,00	
IMA-B	-0,23	-0,32	0,54	0,60	1,00

Data: setembro/2024

RENTABILIDADE DOS ÚLTIMOS MESES

	Fundo	CDI	% CDI
set-24	-1,26%	0,83%	-
ago-24	-1,12%	0,87%	-
jul-24	-4,01%	0,91%	-
jun-24	0,28%	0,79%	35,08%
mai-24	-0,01%	0,83%	-
abr-24	-0,88%	0,89%	-
mar-24	0,16%	0,83%	19,13%
fev-24	1,54%	0,80%	191,84%
jan-24	4,57%	0,97%	472,49%
dez-23	1,78%	0,90%	198,48%
nov-23	-0,91%	0,92%	-
out-23	1,68%	1,00%	168,72%

SETORES COM MAIORES EXPOSIÇÕES (GROSS)



Data: 30/08/2024

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

Ano	Fundo	CDI	% CDI
2024	-0,9%	8,0%	-11,8%
2023	16,5%	13,0%	126,5%
2022	7,2%	5,5%	131,2%
Início	23,8%	28,8%	82,4%

ESTATÍSTICAS

	Fundo	CDI	Ibovespa
Retorno Anualizado Início	10,34%	12,40%	11,98%
Retorno 3 Meses	-6,28%	2,63%	6,38%
Retorno 6 Meses	-6,85%	5,23%	2,90%
Retorno 12 Meses	1,58%	11,06%	13,08%
Volatilidade Anualizada Início	7,99%	0,08%	18,31%
Máximo Drawdown	-9,56%	-	-18,35%
Maior Retorno Mensal	4,98%	1,17%	12,54%
Menor Retorno Mensal	-4,01%	0,79%	-7,49%
Meses Positivos	17	26	15
Meses Negativos	9	-	11
Meses Acima do CDI	13	-	13
Meses Abaixo do CDI	13	-	13
Beta (vs IBOV desde início)	-0,11	-	-
Índice de Sharpe	-0,19	-	-

EXPOSIÇÃO E CONCENTRAÇÃO EM AÇÕES

Número de Posições Long	116
Número de Posições Short	82
Maior Posição Long (% PL)	2,29%
Maior Posição Short (% PL)	-2,29%
Total Long (% PL)	83,48%
Total Short (% PL)	-60,69%

EXPOSIÇÃO POR MARKET CAP

Market Cap (% PL)	Long	Short	Net
Large (> R\$10 bi)	27,66%	-18,95%	8,71%
Mid (R\$1 bi - R\$10 bi)	43,08%	-31,17%	11,91%
Small (<R\$1 bi)	13,33%	-11,07%	2,26%

Data: 30/08/2024

Material de Divulgação. Este documento não leva em consideração objetivos de investimentos, situação financeira ou necessidades particulares a serem consideradas no processo de investimento. Leia a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir, em especial a seção de Fatores de Risco. Este fundo está sujeito a risco de perda substancial de seu patrimônio líquido em caso de eventos que afetem o não pagamento dos ativos integrantes de sua carteira, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo. Para informações completas sobre os limites por emissor aplicáveis ao fundo consulte seu Regulamento. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de saída. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Crédito. Para avaliação da performance do fundo de investimentos, é recomendável uma análise de período de, no mínimo, 12 (doze) meses. É fundamental a leitura do regulamento dos fundos antes de qualquer decisão de investimento. Os fundos de investimento podem utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento, sendo que tais estratégias podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus colistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo dos fundos. Ainda que o gestor mantenha sistema de gerenciamento de riscos, não há garantia de completa eliminação da possibilidade de perdas para o fundo de investimento e para o investidor. Para mais informações, ligue para (51) 11 3526 2250 ou acesse www.azquest.com.br. O regulamento do fundo poderá ser obtido no site da CVM (www.cvm.gov.br). Os limites de movimentação citados são referentes à modalidade conta e ordem. A taxa de administração prevista acima é a taxa de administração mínima do Fundo. Supervisão e Fiscalização: a. Comissão de Valores Mobiliários - CVM; b. Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.

