

# Banco Daycoval

## Quadro de **RENTABILIDADES**

Apesar de toda volatilidade do mercado e dos stress causados por assuntos políticos internos (primordialmente Reforma da Previdência) e externos (Guerra Comercial entre EUA e China) o investidor que assumiu maior risco na sua carteira de investimentos no primeiro semestre foi beneficiado pelo retorno obtido, tanto juro de longo prazo quanto o mercado de renda variável apresentaram retornos importantes.

Desde o início de 2019, o IMAB-5 (índice que representa a média de retorno de NTN's com vencimentos até cinco anos) rendeu +7,28%, representando o melhor retorno para fundos que capturam prêmio em juros. Outro indicador foi o Ibovespa, com aumento de +14,88% e índice de Small Caps +19,26%, Já o PTAX (média das variações de contrato de venda de dólar) chegou a +5,96% no dia 20 de maio, mas perdeu força e encerrou o semestre com -1,10%.

O mercado internacional mostra dados fracos de atividade econômica, o que dá espaço aos principais Bancos Centrais do mundo de reavaliar a política monetária praticada. O Banco Central dos Estados Unidos (Federal Reserve – FED) divulgou alterações relevantes, sugerindo que ajustes podem ocorrer ainda em 2019. Para o Fed, a economia americana apresenta dinamismo moderado e ausência de pressões inflacionárias. O Banco Central Europeu (BCE) indicou adiamento na redução do quantitative easy para 2020 e adicionalmente, mostrou-se disposto a utilizar outros instrumentos de estímulo. Na China, a economia cresceu 6,4% no 1TRI, interrompendo sequência de três trimestres de desaceleração. Outra notícia positiva para os mercados foi a trégua da guerra comercial entre EUA e China, as potências concordaram em suspender novas tarifas e retomaram as negociações que foram suspendidas em Maio, sinalizando um tom mais positivo para o desfecho. Além disso, Trump concordou em permitir que empresas americanas voltassem a vender material tecnológico à Huawei (empresa fabricante de smartphones), que se tornou um dos símbolos deste impasse.

No Brasil, o Banco Central reduziu a previsão para crescimento do PIB em 2019 de 2% para 0,8%. No relatório trimestral, o indicador de FBCF (Formação Bruta de Capital Fixo) ainda não mostra sinais de recuperando, notadamente sobre as incertezas sobre a organização das contas públicas e principalmente na expectativa da aprovação da PEC da Previdência Social. No relatório, o BC também mencionou sobre a taxa de desocupação ainda elevada, apesar da modesta recuperação, até maio a taxa de desemprego apresentou 12,3%, segundo pesquisa divulgada pelo IBGE.

A inflação medida pelo IPCA-15 de Junho variou apenas 0,06% em relação a maio, resultando de devolução de choques de alimentos que ocorreu em março e abril. Os dados mostram ainda, uma continuidade na queda dos preços para os próximos meses. A expectativa da área macroeconômica do Banco Daycoval é inflação de 3,9% (IPCA) para este ano.

## Fundos de investimentos disponíveis na Plataforma do Banco Daycoval no mês de Junho.

O critério de avaliação para realizar o quadro de rentabilidade é definido única e exclusivamente pelo retorno dos últimos seis meses na coluna “6M”, do maior para o menor, organizado pelo tipo de “Estratégia”

AÇÕES	RENTABILIDADES												CARACTERÍSTICAS				
	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017		PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov					
<b>Retorno Ibovespa</b>	<b>4,06%</b>		<b>14,88%</b>		<b>40,69%</b>		<b>14,88%</b>		<b>15,03%</b>		<b>26,86%</b>						
Indie FIC FIA <sup>1</sup>	5,15%	1,09%	19,20%	4,32%	44,00%	3,31%	19,21%	4,33%	14,15%	-0,88%	44,87%	18,01%	214,43	20,03%	5.000	D+30	IBX-100
Constancia Fundamento FIA	5,14%	1,08%	18,25%	3,37%	51,07%	10,38%	18,26%	3,38%	22,85%	7,82%	32,51%	5,65%	157,60	17,70%	1.000	D+14	Ibovespa
Athena Total Return II FIC FIA <sup>1</sup>	5,68%	1,62%	18,16%	3,28%	41,59%	0,90%	18,17%	3,29%	7,48%	-7,55%	24,23%	-2,63%	83,43	13,18%	5.000	D+30	Não Há
Moat Capital FIC FIA	5,41%	1,35%	16,60%	1,72%	50,84%	10,15%	16,61%	1,73%	30,15%	15,12%	45,59%	18,73%	1.056,69	24,38%	20.000	D+15	Ibovespa
Alaska Black FIC FIA II Bdr Nivel I	10,08%	6,02%	16,15%	1,27%	54,08%	13,39%	16,15%	1,27%	31,33%	16,30%	-	-	401,90	34,17%	1.000	D+30	Ibovespa
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	3,75%	-0,31%	15,99%	1,11%	42,22%	1,53%	16,00%	1,12%	19,82%	4,79%	26,61%	-0,25%	59,76	21,23%	500	D+15	Ibovespa
<b>Spx Patriot FIC FIA <sup>1</sup></b>	4,18%	0,12%	15,72%	0,84%	37,09%	-3,60%	15,72%	0,84%	16,18%	1,15%	33,92%	7,06%	191,50	17,55%	50.000	D+60	IBX-100
Dahlia Total Return FIC FIM <sup>1</sup>	3,85%	-0,21%	15,49%	0,61%	33,00%	-7,69%	15,48%	0,60%	-	-	-	-	144,10	10,09%	5.000	D+30	Não Há
Occam FIC FIA	3,41%	-0,65%	13,21%	-1,67%	40,84%	0,15%	13,22%	-1,66%	22,85%	7,82%	25,76%	-1,10%	241,05	20,19%	5.000	D+15	Ibovespa
ARX Long Term FIC FIA <sup>1</sup>	5,63%	1,57%	11,68%	-3,20%	40,73%	0,04%	11,69%	-3,19%	19,47%	4,44%	29,20%	2,34%	85,47	20,54%	5.000	D+30	Não se Aplica
ARX Income FIA <sup>1</sup>	3,81%	-0,25%	11,66%	-3,22%	40,12%	-0,57%	11,67%	-3,21%	29,50%	14,47%	23,31%	-3,55%	328,88	21,65%	500	D+1	Não se Aplica
<b>Spx Falcon FIC FIA <sup>1+IQ</sup></b>	2,74%	-1,32%	10,02%	-4,86%	21,40%	-19,29%	10,01%	-4,87%	10,82%	-4,21%	19,96%	-6,90%	1.183,48	8,78%	50.000	D+60	IPCA + 6%
Az Quest Acoes FIC FIA	3,39%	-0,67%	9,97%	-4,91%	34,36%	-6,33%	9,97%	-4,91%	26,12%	11,09%	24,54%	-2,32%	716,88	21,82%	10.000	D+1	Ibovespa
Alaska Black Institucional FIA <sup>1</sup>	3,70%	-0,36%	4,87%	-10,01%	22,73%	-17,96%	4,88%	-10,00%	32,37%	17,34%	-	-	678,02	20,08%	1.000	D+30	Não Há

**CAMBIAL**
**RENTABILIDADES**
**CARACTERÍSTICAS**

	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017		PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
	Retorno	Diferencial PTAX	Retorno	Diferencial PTAX													
<b>Retorno PTAX</b>	<b>-2,75%</b>		<b>-1,10%</b>		<b>-0,52%</b>		<b>-1,10%</b>		<b>17,13%</b>		<b>1,50%</b>						
Occam FI Cambial	-2,03%	0,72%	0,39%	1,49%	1,88%	2,40%	0,36%	1,46%	19,17%	2,04%	2,14%	0,64%	26,58	13,96%	5.000	D+0	PTAX

**CRÉDITO PRIVADO**
**RENTABILIDADES**
**CARACTERÍSTICAS**

	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017		PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
	Retorno	%CDI															
<b>Retorno CDI</b>	<b>0,47%</b>		<b>3,10%</b>		<b>6,35%</b>		<b>3,07%</b>		<b>6,42%</b>		<b>9,93%</b>						
Capitania Reit 90 CP FIC FIM <sup>1,2+1Q</sup>	1,37%	292,67%	11,62%	374,97%	-	-	11,63%	378,17%	-	-	-	-	27,50	4,20%	5.000	D+90	IFIX
Empirica Lotus FIC FIM CP <sup>1Q</sup>	0,70%	149,91%	4,44%	143,31%	9,56%	150,73%	4,41%	143,29%	9,76%	152,02%	12,48%	125,72%	165,06	0,06%	25.000	D+90	CDI
Valora Guardian FIC FIM CP <sup>1Q</sup>	0,60%	128,86%	3,83%	123,49%	7,83%	123,34%	3,80%	123,50%	7,92%	123,41%	11,99%	120,79%	210,72	0,05%	10.000	D+90	CDI
Valora Guardian II FIC FIM CP <sup>1Q</sup>	0,58%	124,74%	3,70%	119,45%	7,56%	119,22%	3,67%	119,46%	7,66%	119,26%	11,73%	118,14%	146,03	0,05%	10.000	D+90	CDI
ARX Vinson FIRF CP <sup>2</sup>	0,51%	108,27%	3,59%	115,89%	-	-	3,57%	116,01%	-	-	-	-	679,21	0,22%	1.000	D+30	CDI
Daycoval Classic 30 FIRF CP <sup>2</sup>	0,52%	111,27%	3,55%	114,65%	-	-	3,53%	114,71%	-	-	-	-	78,74	0,10%	500	D+29	CDI
Ca Indosuez Grand Vitesse FIRF CP <sup>2+1Q</sup>	0,49%	105,35%	3,45%	111,31%	-	-	3,43%	111,42%	-	-	-	-	148,01	0,20%	1.000	D+30	CDI
Dlm Hedge Conserv II FIRF CP	0,48%	101,37%	3,40%	109,74%	7,09%	111,80%	3,37%	109,72%	7,26%	113,12%	11,10%	111,84%	1.639,75	0,10%	3.000	D+0	CDI
Capitania Premium FICFI RF CP	0,68%	145,92%	3,37%	108,68%	7,00%	110,38%	3,34%	108,67%	6,64%	103,39%	11,17%	112,58%	183,84	0,70%	5.000	D+44	CDI
Daycoval Classic FIRF CP	0,50%	106,41%	3,36%	108,45%	6,90%	108,74%	3,34%	108,51%	6,98%	108,66%	10,68%	107,60%	1.310,67	0,07%	500	D+5	CDI
Daycoval Classic Inst FIRF CP	0,48%	102,90%	3,23%	104,09%	6,85%	107,92%	3,20%	104,12%	-	-	-	-	20,25	0,12%	500	D+5	CDI
Az Quest Luce FIC FIRF CP LP	0,46%	98,77%	3,20%	103,27%	6,66%	104,91%	3,18%	103,31%	6,78%	105,54%	10,53%	106,04%	5.131,24	0,06%	5.000	D+0	CDI
Capitania Top CP FIC FIRF	0,22%	46,67%	3,17%	102,31%	6,64%	104,58%	3,14%	102,22%	6,85%	106,74%	10,04%	101,20%	433,83	0,67%	5.000	D+0	CDI
Daycoval RFFI CP	0,03%	107,04%	3,16%	101,84%	6,45%	101,72%	3,13%	101,83%	6,37%	99,18%	9,74%	98,12%	200,86	0,04%	500	D+0	CDI
Brasil Plural High Yield FIRF CP	0,02%	96,22%	3,09%	99,80%	6,37%	100,42%	3,07%	99,82%	6,51%	101,37%	10,17%	102,44%	763,04	0,05%	3.000	D+0	CDI
Brasil Plural Yield FIRF Ref DI	0,02%	96,65%	2,98%	96,23%	6,11%	96,35%	2,96%	96,24%	6,24%	97,11%	10,08%	101,58%	250,81	0,01%	3.000	D+0	CDI

## DEBÊNTURES

### RENTABILIDADES

### CARACTERÍSTICAS

	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017		PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
	Retorno	%CDI															
<b>Retorno CDI</b>																	
	<b>0,47%</b>		<b>3,10%</b>		<b>6,35%</b>		<b>3,07%</b>		<b>6,42%</b>		<b>9,93%</b>						
Daycoval Deb Inc CP FIM <sup>1</sup>	1,27%	270,54%	5,36%	173,04%	10,08%	158,94%	5,35%	173,87%	7,84%	122,16%	9,50%	95,67%	53,12	0,91%	100	D+30	Não se Aplica
Brasil Plu Deb In 45 CP FIC FIM	0,98%	208,94%	5,27%	169,97%	10,70%	168,67%	5,25%	170,70%	10,30%	160,40%	8,50%	85,65%	144,75	1,21%	100	D+45	CDI
Brasil Plural Deb In 30 CP	0,99%	210,98%	5,23%	168,67%	10,73%	169,16%	5,21%	169,43%	10,23%	159,26%	8,58%	86,46%	40,99	1,18%	100	D+30	CDI
Rb Capital Deb In FIC FIM CP	0,69%	147,58%	4,50%	145,15%	9,83%	154,89%	4,48%	145,76%	9,75%	151,91%	11,29%	113,76%	139,27	0,95%	1.000	D+20	CDI

## TÍTULOS PÚBLICOS

### RENTABILIDADES

### CARACTERÍSTICAS

	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017		PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
	Retorno	Dif. IMAB-5	Retorno	Dif. IMAB-5	Retorno	Dif. IMAB-5	Retorno	Dif. IMAB-5	Retorno	Dif. IMAB-5	Retorno	Dif. IMAB-5					
<b>Retorno IMAB-5</b>																	
	<b>1,72%</b>		<b>7,30%</b>		<b>14,79%</b>		<b>7,28%</b>		<b>9,87%</b>		<b>12,58%</b>						
Daycoval Fundo de RF Ima B5	1,65%	-0,07%	6,90%	-0,40%	13,94%	-0,85%	6,88%	-0,40%	9,01%	-0,86%	12,07%	0,51%	48,04	2,43%	500	D+2	IMAB-5

## INVEST. NO EXTERIOR

### RENTABILIDADES

### CARACTERÍSTICAS

	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017		PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
	Retorno	%CDI															
<b>Retorno CDI</b>																	
	<b>0,47%</b>		<b>3,10%</b>		<b>6,35%</b>		<b>3,07%</b>		<b>6,42%</b>		<b>9,93%</b>						
Claritas Global High Yield FIM IE <sup>1Q</sup>	2,11%	449,35%	9,70%	312,94%	7,07%	111,46%	9,61%	312,47%	-1,66%	-25,81%	14,17%	142,77%	64,77	3,02%	25.000	D+1	CDI
Pimco Income FIC FIM IE <sup>1Q</sup>	1,56%	332,77%	7,47%	240,97%	9,69%	152,78%	7,30%	237,41%	3,12%	48,58%	14,11%	142,20%	908,87	1,83%	25.000	**	CDI
Nw3 Event Driven FIC FIM <sup>1Q</sup>	0,40%	85,56%	4,20%	135,55%	8,20%	129,22%	4,04%	131,37%	7,81%	121,57%	12,44%	125,35%	87,68	3,30%	50.000	D+30	CDI

## LONG & SHORT

### RENTABILIDADES

### CARACTERÍSTICAS

	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017	
	Retorno	%CDI										
<b>Retorno CDI</b>	<b>0,47%</b>		<b>3,10%</b>		<b>6,35%</b>		<b>3,07%</b>		<b>6,42%</b>		<b>9,93%</b>	
Occam LS Plus FIC FIA	1,12%	238,36%	4,98%	160,75%	17,30%	272,70%	5,05%	164,16%	16,78%	261,32%	11,94%	120,27%
Ibiuna Long Short Stls FIC FIM	2,22%	474,47%	4,09%	131,83%	3,34%	52,68%	4,11%	133,55%	8,25%	128,41%	14,56%	146,68%
Xp Long Short 60 FIC FIM	1,48%	315,89%	3,53%	114,00%	4,46%	70,35%	3,52%	114,43%	11,11%	172,95%	2,40%	24,18%
Sharp Long Short FIM	0,74%	157,96%	3,23%	104,34%	8,04%	126,75%	3,22%	104,61%	9,15%	142,46%	10,64%	107,23%
Moat Capital Equity Hedge FIC FIM	2,00%	426,95%	2,87%	92,55%	8,48%	133,72%	2,85%	92,76%	7,70%	119,92%	10,57%	106,48%
ARX LS FIC FIM	1,16%	247,04%	2,09%	67,45%	6,33%	99,71%	2,08%	67,77%	5,96%	92,75%	9,88%	99,56%
Az Quest Total Return FIC FIM	1,71%	365,06%	1,28%	41,44%	7,10%	111,90%	1,28%	41,66%	12,85%	200,04%	12,05%	121,37%

PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
44,53	8,07%	5.000	D+30	CDI
348,91	7,25%	5.000	D+30	CDI
387,84	4,88%	10.000	D+60	CDI
328,78	1,37%	50.000	D+15	CDI
97,98	5,09%	20.000	D+30	CDI
73,36	2,70%	20.000	D+4	CDI
1.126,84	4,88%	5.000	D+27	CDI

## LONG BIASED

### RENTABILIDADES

### CARACTERÍSTICAS

	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017	
	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov	Retorno	Diferencial do Ibov
<b>Retorno Ibovespa</b>	<b>4,06%</b>		<b>14,88%</b>		<b>40,69%</b>		<b>14,88%</b>		<b>15,03%</b>		<b>26,86%</b>	
Oceana Long Biased FIC FIA <sup>1+IQ</sup>	3,22%	-0,84%	15,77%	0,89%	36,53%	-4,16%	15,77%	0,89%	13,34%	-1,69%	26,49%	-0,37%
Oceana Long Biased FIC FIM <sup>1</sup>	3,22%	-0,84%	15,74%	0,86%	36,63%	-4,06%	15,75%	0,87%	13,36%	-1,67%	26,35%	-0,51%
Pacifico Lb FIC FIM <sup>1</sup>	4,35%	0,29%	11,48%	-3,40%	33,92%	-6,77%	11,45%	-3,43%	13,15%	-1,88%	20,96%	-5,90%
Vinland Long Bias FIC FIM <sup>1+IQ</sup>	3,55%	-0,51%	9,65%	-5,23%	16,41%	-24,28%	9,68%	-5,20%	-	-	-	-
Az Quest Top Long Biased FIC FIA <sup>1</sup>	4,21%	0,15%	9,03%	-5,85%	35,96%	-4,73%	9,03%	-5,85%	38,75%	23,72%	31,85%	4,99%
Apex Long Biased FIC FIM <sup>1</sup>	3,63%	-0,43%	8,95%	-5,93%	25,21%	-15,48%	9,02%	-5,86%	27,08%	12,05%	-	-

PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
672,22	10,51%	50.000	***	IPCA + 6%
287,06	10,54%	50.000	***	Não se Aplica
236,53	14,50%	50.000	D+30	IPCA + 6%
9,02	11,91%	50.000	D+60	IPCA + Yield do IMAB
486,35	21,85%	10.000	D+30	IBX-100
169,41	13,67%	5.000	D+30	CDI

MULTIMERCADO

RENTABILIDADES

CARACTERÍSTICAS

	RENTABILIDADES												CARACTERÍSTICAS				
	JUNHO		6 MESES		12 MESES		2019		2018		2017		PL Médio 12M (MM)	Vol 12M (%)	Investimento Inicial	Cota de Resgate	Benchmark
<b>Retorno CDI</b>	<b>0,47%</b>		<b>3,10%</b>		<b>6,35%</b>		<b>3,07%</b>		<b>6,42%</b>		<b>9,93%</b>						
Canvas Vector FIC FIM	2,39%	509,69%	18,13%	584,81%	23,97%	377,85%	18,06%	587,41%	7,58%	118,03%	-	-	59,90	5,67%	20.000	D+29	CDI
Canvas Enduro II FIC FIM	2,93%	625,07%	9,34%	301,31%	15,17%	239,03%	9,33%	303,48%	7,16%	111,51%	13,71%	138,17%	463,11	5,92%	20.000	D+29	CDI
Gap Absoluto FIC FIM	3,90%	832,74%	8,74%	282,12%	11,03%	173,79%	8,72%	283,71%	7,23%	112,60%	12,54%	126,36%	90,95	4,70%	5.000	D+30	CDI
Gap Multiportfolio FIC FIM	3,87%	826,24%	8,67%	279,57%	10,56%	166,49%	8,64%	281,15%	6,03%	93,95%	12,29%	123,87%	198,88	4,64%	5.000	D+0	CDI
Occam Retorno Absoluto FIM	2,31%	491,70%	8,35%	269,25%	20,22%	318,75%	8,36%	272,00%	17,83%	277,63%	14,04%	141,50%	246,91	6,87%	10.000	D+30	CDI
Mzk Dinamico FIC FIM	2,16%	485,92%	7,20%	232,32%	9,78%	154,11%	7,18%	233,68%	-	-	-	-	221,09	3,72%	10.000	D+30	CDI
Canvas Classic II FIC FIM	2,08%	443,64%	7,09%	228,82%	11,72%	184,76%	7,08%	230,38%	6,26%	97,49%	12,04%	121,27%	243,89	4,14%	20.000	D+29	CDI
Vintage Macro FIC FIM IQ	0,85%	182,03%	6,52%	210,40%	8,96%	141,26%	6,24%	202,86%	5,47%	85,13%	10,28%	103,54%	286,97	4,87%	100.000	D+30	CDI
Kapitalo Kappa Fin FIC FIM	2,41%	514,03%	6,10%	196,76%	8,82%	139,03%	6,10%	198,36%	12,08%	188,13%	14,98%	150,88%	1.833,94	4,74%	50.000	D+30	CDI
Bahia Am Marau FIC FIM	1,33%	282,93%	6,07%	195,75%	9,52%	150,08%	6,03%	196,13%	9,94%	154,77%	22,72%	228,90%	5.494,39	2,69%	20.000	D+30	CDI
Az Quest Multi Max FIC FIM	3,94%	841,40%	5,81%	187,53%	9,77%	153,99%	5,78%	187,87%	11,40%	177,47%	-	-	394,66	6,45%	25.000	D+29	CDI
Garde D Artagnan FIC FIM	2,10%	447,47%	5,24%	168,98%	7,26%	114,47%	5,15%	167,68%	1,78%	27,78%	14,64%	147,50%	2.051,30	3,89%	50.000	D+30	CDI
Pacifico Macro FIC FIM	1,74%	371,29%	5,11%	164,75%	8,48%	133,64%	5,09%	165,64%	8,54%	132,93%	16,24%	163,63%	296,51	4,83%	50.000	D+30	CDI
Kapitalo Alpha Global FIC FIM IQ	1,56%	333,15%	5,05%	162,95%	3,15%	49,63%	5,04%	164,01%	0,45%	6,96%	-	-	23,10	4,21%	50.000	D+30	CDI
Truxt I Macro FIC FIM	1,87%	399,55%	4,83%	155,92%	5,89%	92,76%	4,82%	156,79%	6,53%	101,72%	-	-	1.000,46	3,22%	20.000	D+30	CDI
Daycoval Multifunds FIC FIM	1,32%	281,37%	4,59%	148,24%	7,33%	115,48%	4,47%	145,55%	5,87%	91,46%	11,48%	115,64%	43,49	1,82%	500	D+15	CDI
Daycoval Multiestrategia FIM	0,66%	140,68%	4,48%	144,42%	8,87%	139,76%	4,47%	145,40%	6,91%	107,57%	10,17%	102,51%	23,13	0,85%	500	D+1	CDI
Canepa Macro FIC FIM	0,99%	211,00%	4,36%	140,67%	5,62%	88,52%	4,34%	141,29%	6,70%	104,35%	13,21%	133,06%	213,14	3,80%	25.000	D+15	CDI
Vinland Macro FIC FIM	1,96%	417,16%	4,36%	140,59%	9,06%	142,76%	4,36%	141,79%	-	-	-	-	48,47	3,87%	50.000	D+30	CDI
Az Quest Multi 15 FIC FIM	2,23%	475,94%	4,25%	137,14%	8,07%	127,20%	4,22%	137,32%	9,12%	141,97%	-	-	63,85	3,63%	10.000	D+14	CDI
Az Quest Mult FIC FIM	2,15%	458,85%	4,24%	136,82%	8,23%	129,68%	4,21%	137,00%	9,32%	145,10%	14,28%	143,86%	621,41	3,59%	10.000	D+1	CDI
Adam Macro II FIC FIM	-0,80%	-	3,47%	112,00%	7,53%	118,66%	3,38%	109,94%	4,97%	77,41%	15,17%	152,83%	2.839,52	3,23%	50.000	D+30	CDI
Sf2 Tropico Cash FIM	0,50%	107,52%	3,31%	106,63%	6,71%	105,76%	3,28%	106,75%	6,81%	106,10%	10,57%	106,52%	52,48	0,13%	5.000	D+1	CDI
Adam Macro Stra. II D60 FIC FIM	-1,40%	-	2,71%	87,31%	5,76%	90,76%	2,61%	84,82%	-	-	-	-	548,25	3,85%	25.000	D+60	CDI
Adam Macro Strategy II FIC FIM	-1,40%	-	2,70%	87,12%	5,78%	91,12%	2,60%	84,46%	7,29%	113,58%	-	-	3.657,73	3,74%	50.000	D+30	CDI
Rps Equity Hedge D30 FIC FIM	1,53%	327,29%	2,48%	79,92%	5,95%	93,73%	2,47%	80,42%	10,38%	161,62%	11,55%	116,39%	501,50	3,43%	50.000	D+30	CDI
ARX Extra FIC FIM	1,13%	240,73%	1,98%	63,75%	5,91%	93,16%	1,97%	63,93%	5,98%	93,16%	13,10%	132,03%	262,47	4,22%	20.000	D+30	CDI
Maua Macro FIC FIM	2,94%	626,61%	1,51%	48,57%	2,45%	38,67%	1,49%	48,49%	3,62%	56,42%	16,38%	165,05%	1.309,36	6,95%	5.000	D+29	CDI

Fonte: Sistema Económica

A classificação do Produto e os principais Fatores de Risco e de liquidez de cada fundo de investimento está disponível no site do Banco Daycoval através dos links: <https://www.daycoval.com.br/para-voce/investimentos-pessoa-fisica/fundos-terceiros> e <https://www.daycoval.com.br/Asset/Fundos/NossosFundos?lang=ptbr>

■ Temporariamente fechado para Captação

IQ - Fundo destinado à investidores qualificados

<sup>1</sup> - O índice de comparação trata-se de mera referência econômica e não meta ou parâmetro de performance

<sup>2</sup> - Este fundo tem menos de 12 (doze) meses. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendada a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O seu Patrimônio Líquido está informado desde o início de sua série de cotas, que possui menos do que 12 (doze) meses.

<sup>3</sup> - Fundo processado somente às quartas-feiras úteis, considerando feriados nacionais e/ou feriados onde o fundo máster possui ativos na carteira.

\*\* - A cota de conversão do resgate é fixada no 5º dia útil do 2º mês subsequente ao pedido de resgate

\*\*\* - Caso a data do pedido do resgate seja realizada até o 10º dia do mês em curso, a conversão do resgate é realizada no último dia útil do mês. Caso o pedido de resgate seja realizado após o 10º dia do mês, a conversão é realizada no último dia útil do mês subsequente.

**Aviso Importante:** A rentabilidade divulgada já é líquida das taxas de administração, de performance e dos outros custos pertinentes ao fundo, desde que respeitar o prazo padrão de conversão de resgates. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. O Valor da cota, patrimônio e rentabilidade são divulgados diariamente em jornal de grande circulação. O investimento em Fundo não é garantido pelo Fundo Garantidor de Crédito (FGC). Leia o formulário de informações complementares, a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo fundo garantidor de crédito. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. Para a avaliação de performance de fundos de investimento, é recomendável uma análise de no mínimo doze meses; É recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento dos fundos de investimento pelo investidor ao aplicar seus recursos. Qualquer divulgação de informação sobre os resultados do fundo só pode ser feita, por qualquer meio, após um período de carência de 6 (seis) meses, a partir da data da primeira emissão de cotas. Os fundos de investimentos discutidos neste e-mail podem não ser adequados para todos os investidores. Investimentos nos mercados de financeiros e de capitais estão sujeitos a riscos de perda superior ao valor total do capital investido. Este material não leva em consideração os objetivos de investimento, situação financeira ou necessidades específicas de qualquer investidor. Os investidores devem obter orientação financeira, com base em seu perfil de investidor, antes de tomar uma decisão de investimento. Aos investidores é recomendada a leitura cuidadosa de prospectos e regulamentos ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. Este e-mail é destinado à circulação exclusiva para a rede de relacionamento do Banco Daycoval S/A. Fica proibida sua reprodução ou redistribuição para qualquer pessoa, no todo ou em parte, qualquer seja o propósito, sem o prévio consentimento expresso do Banco Daycoval S/A. Esta instituição é aderente ao código Anbima de Regulação e Melhores Práticas para atividade de Distribuição de Produtos de Investimento.



Distribuição de Produtos de Investimento