

OBJETIVO

Fundo long-biased sistemático, que aloca em fatores de risco de ações e de outros mercados, com mais de 150 posições, entre compradas e vendidas, procurando obter retornos superiores ao IMA-B 5+.

PÚBLICO-ALVO

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

CARACTERÍSTICAS

DATA DE INÍCIO:

29/05/2020

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO:

2,0% ao ano

TAXA DE PERFORMANCE:

20% sobre o que exceder o IMA-B 5+

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:

Ações

CLASSIFICAÇÃO CVM:

Multimercado

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA:

Multimercados Livre

CÓDIGO ANBIMA:

542520

CNPJ:

36.499.625/0001-97

GESTOR:

Bayes Capital Management e AZ Quest Investimentos

ADMINISTRADOR:

BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM

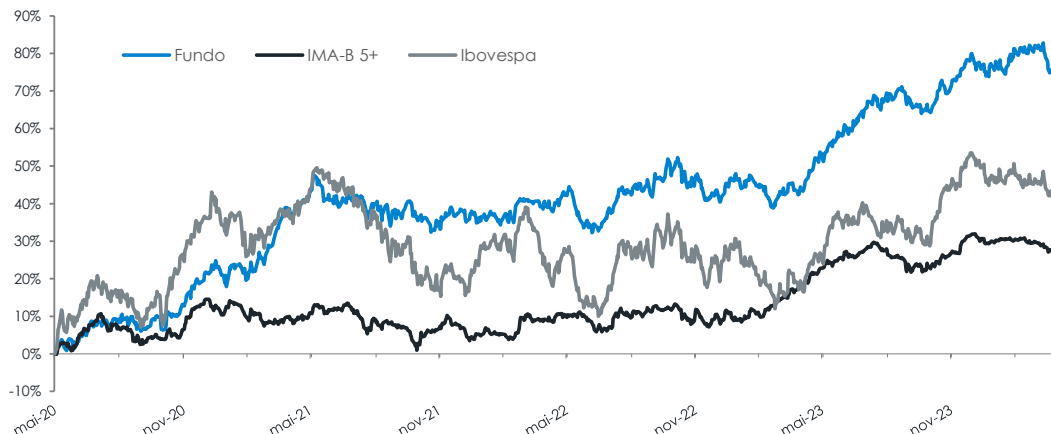
CUSTODIANTE:

Banco BTG Pactual S.A.

AUDITOR:

EY

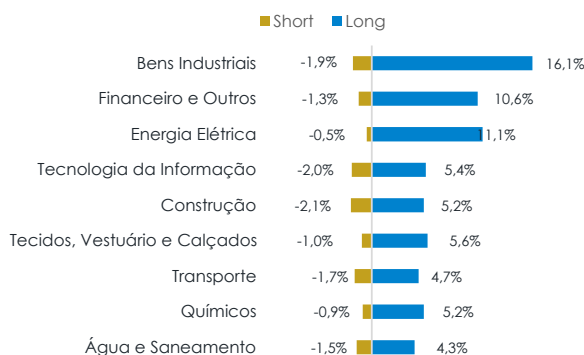
PERFORMANCE ACUMULADA



RENTABILIDADE ÚLTIMOS 12 MESES

	Fundo	IMA-B 5+	Ibovespa
abr-24	-4,17%	-2,91%	-1,70%
mar-24	0,83%	-0,55%	-0,71%
fev-24	2,30%	0,51%	0,99%
jan-24	-1,87%	-1,47%	-4,79%
dez-23	4,71%	3,94%	5,38%
nov-23	4,65%	3,39%	12,54%
out-23	-2,48%	-0,98%	-2,94%
set-23	0,71%	-1,92%	0,71%
ago-23	0,98%	-1,27%	-5,09%
jul-23	2,83%	0,73%	3,27%
jun-23	6,48%	3,37%	9,00%
mai-23	4,66%	4,13%	3,74%

MAIORES EXPOSIÇÕES POR SETOR



Data: 28/03/2024

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

	Fundo	IMA-B 5+	Ibovespa
2024	-3,00%	-4,38%	-6,16%
2023	25,28%	19,28%	22,28%
2022	3,82%	3,30%	4,69%
2021	13,61%	-6,55%	-11,93%
2020	21,77%	14,53%	36,17%
Início	74,5%	26,1%	44,1%

RETORNO POR SUBESTRATÉGIA - NO ANO

Ações Long Only	-0,82%
Ações Long-Short	2,23%
Bayes Global Systematic Fund	-0,10%
Títulos Públicos	0,23%

EXPOSIÇÃO E CONCENTRAÇÃO EM AÇÕES

Número de Posições Long	112
Número de Posições Short	86
Maior Posição Long (% PL)	3,30%
Maior Posição Short (% PL)	-1,01%
Total Long (% PL)	100,21%
Total Short (% PL)	-22,56%

Data: 28/03/2024

ESTATÍSTICAS

	Fundo	IMA-B 5+	Ibovespa
Retorno Anualizado Início	15,33%	6,12%	9,80%
Retorno 6 Meses	6,29%	2,77%	11,30%
Retorno 12 Meses	20,80%	6,84%	20,58%
Retorno 24 Meses	25,07%	15,52%	16,73%
Volatilidade Anualizada Início	11,55%	8,21%	19,71%
Máximo Drawdown	-10,32%	-11,88%	-26,50%
Maior Retorno Mensal	7,98%	7,51%	15,90%
Menor Retorno Mensal	-6,61%	-3,87%	-11,50%
Beta (vs IMA-B 5+ desde início)	0,64	-	1,12
Última Quota Divulgada	1,745396		
PL Atual	R\$ 37.302.885		
PL Médio últ. 12 meses	R\$ 30.528.240		

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 cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista 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 (55) 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. Site: <https://azquest.com.br/az-quest-bayes-long-biased-sistemico-fim/>



Gestão de Recursos