

INVESTMENT SOLUTIONS

Fundos Multimercados

JUNHO / 2022

Carteira Multimercados – Junho 2022

FUNDO	INDEXADOR	LIQUIDEZ	ALOCAÇÃO
GRIPEN ADVISORY FIC FIM (SPX NIMITZ)	CDI	D+60 / D+1	13,00%
LEGACY CAPITAL ADVISORY FIC FIM	CDI	D+30 / D+1	13,00%
GIANT ZARATHUSTRA ADVISORY	CDI	D+30 / D+1	12,00%
XP MACRO PLUS FIC FIM	CDI	D+30 / D+1	12,00%
KAPITALO K10 ADVISORY FIC FIM	CDI	D+30 / D+1	12,00%
VINLAND MACRO PLUS ADVISORY FIC FIM	CDI	D+30 / D+1	12,00%
ABSOLUTE VERTEX ADVISORY FIC FIM	CDI	D+44 / D+1	10,00%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FIM	CDI	D+30 / D+1	8,00%
AZ QUEST MULTI MAX FIC FIM	CDI	D+29 / D+1	8,00%
			100%

Racional

GRIPEN ADVISORY FIC FIM (SPX NIMITZ)

O fundo é um multimercado de estratégia macro de alto risco, buscando oportunidades de investimento em temas macroeconômicos globais e investindo nos mercados de juros, índices de preços, taxas de câmbio, commodities e ações. Objetivo de retorno: CDI + 4-6% a.a. | Objetivo de volatilidade: 4-6% a.a.

LEGACY CAPITAL ADVISORY FIC FIM

Lançado em 2018, é um fundo multimercado com estratégia macro, isto é, suas teses de investimento são baseadas na elaboração de cenários macroeconômicos, que dão suporte para a escolha de classes de ativos específicas e culminam com a montagem de posições dentro do fundo. A tomada das decisões de investimento para o fundo é feita de forma descentralizada, ou ponderada por risco, com uma abordagem de investimentos que combina análises bottom-up e top-down. Com foco em ativos predominantemente locais, mas com exposição internacional, o fundo investe principalmente nos mercados de Juros Brasil, Juros Internacional, Moedas, Ações Brasil e Ações Internacional, podendo investir também, em menor proporção, nos mercados de Commodities. O fundo possui objetivo de retorno de CDI+7% a.a. no longo prazo com uma volatilidade esperada de 7% a.a. . As principais métricas de risco do fundo são VaR e Stress. O fundo apresenta o mecanismo de stop loss por gestor, mas não para o fundo como um todo.

GIANT ZARATHUSTRA ADVISORY

Lançado em 2012, é um fundo multimercado com estratégia quantitativa / sistemática, em que, diferentemente da maioria dos produtos, as teses de investimento são baseadas em algoritmos. O trabalho da equipe de investimentos é, então, criar bases de dados, desenvolver, simular e implementar os algoritmos e monitorar as medidas de risco da carteira. A tomada das decisões para o fundo, bem como as abordagens de investimento são majoritariamente sistemáticas. Com foco em ativos globais, o fundo investe principalmente nos mercados de Juros Brasil, Juros Internacional, Moedas, Ações Brasil e Ações Internacional, podendo investir também, em menor proporção, nos mercados de Commodities. O fundo possui objetivo de retorno de CDI+12% a CDI+15% ao ano no longo prazo com uma volatilidade esperada entre 8 e 12% ao ano. A principal métrica de risco é o Stress. Não há regras de stop loss por gestor, nem para o fundo.

XP MACRO PLUS FIC FIM

Lançado em 2018, é um fundo multimercado com estratégia macro, isto é, suas teses de investimento são baseadas na elaboração de cenários macroeconômicos, que dão suporte para a escolha de classes de ativos específicas e culminam com a montagem de posições dentro do fundo. A tomada das decisões de investimento para o fundo é feita de forma colegiada, com uma abordagem de investimentos que combina análises bottom-up e top-down. Com foco em ativos predominantemente locais, mas com exposição internacional, o fundo investe principalmente nos mercados de Juros Brasil, Juros Internacional, Moedas, Ações Brasil e Ações Internacional. O fundo possui objetivo de retorno de CDI+8% a CDI+12% ao ano no longo prazo com uma volatilidade esperada superior à do CDI. A principal métrica de risco é o VaR. O fundo não apresenta o mecanismo de stop loss por gestor, nem para o fundo como um todo.

KAPITALO K10 ADVISORY FIC FIM

Lançado em 2018, é um fundo multimercado com estratégia macro, isto é, suas teses de investimento são baseadas na elaboração de cenários macroeconômicos, que dão suporte para a escolha de classes de ativos específicas e culminam com a montagem de posições dentro do fundo. A tomada das decisões de investimento para o fundo é feita de forma descentralizada, ou ponderada por risco, com uma abordagem de investimentos majoritariamente Top-down. Com foco em ativos predominantemente locais, mas com exposição internacional, o fundo investe principalmente nos mercados de Juros Brasil, Juros Internacional, Moedas, Ações Brasil e Ações Internacional, podendo investir também, em menor proporção, nos mercados de Commodities e Outros Mercados Globais. O fundo possui objetivo de retorno de CDI+8% a CDI+12% ao ano no longo prazo com uma volatilidade esperada entre 8 e 10% ao ano. A principal métrica de risco é o VaR. O fundo apresenta o mecanismo de stop loss por gestor, mas não para o fundo como um todo.

VINLAND MACRO PLUS ADVISORY FIC FIM

Lançado em 2019, é um fundo multimercado com estratégia macro, isto é, suas teses de investimento são baseadas na elaboração de cenários macroeconômicos, que dão suporte para a escolha de classes de ativos específicas e culminam com a montagem de posições dentro do fundo. A tomada das decisões de investimento para o fundo é feita de forma colegiada, com uma abordagem de investimentos que combina análises bottom-up e top-down. Com foco em ativos predominantemente locais, mas com exposição internacional, o fundo investe principalmente nos mercados de Juros Brasil, Juros Internacional, Moedas, Ações Brasil e Ações Internacional, podendo investir também, em menor proporção, nos mercados de Commodities e Outros Mercados Globais. O fundo possui objetivo de retorno de CDI+8% a.a. no longo prazo com uma volatilidade esperada de 8% a.a. . As principais métricas de risco do fundo são VaR e Stress. O fundo não apresenta o mecanismo de stop loss por gestor, nem para o fundo como um todo.

ABSOLUTE VERTEX ADVISORY FIC FIM

Lançado em 2019, é um fundo multimercado com estratégia macro, isto é, suas teses de investimento são baseadas na elaboração de cenários macroeconômicos, que dão suporte para a escolha de classes de ativos específicas e culminam com a montagem de posições dentro do fundo. A tomada das decisões de investimento para o fundo é feita de forma descentralizada, ou ponderada por risco, com uma abordagem de investimentos que combina análises bottom-up e top-down. Com foco em ativos locais e internacionais, o fundo investe principalmente nos mercados de Juros Brasil, Juros Internacional, Moedas, Ações Brasil, Ações Internacional, Commodities e Outros Mercados Globais, podendo investir também, em menor proporção, nos mercados de Crédito High Grade, Crédito High Yield e Crédito Soberano. O fundo possui objetivo de superar o CDI no longo prazo com uma volatilidade esperada de 10% a.a. . As principais métricas de risco do fundo são VaR e Stress. O fundo apresenta o mecanismo de stop loss por gestor e também para o fundo como um todo.

OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FIM

É um fundo multimercado com estratégia macro, isto é, suas teses de investimento são baseadas na elaboração de cenários macroeconômicos. O fundo apresenta abordagem fundamentalista top-down e atua nos mercados de juros, moedas, ações, commodities e crédito, com foco em Brasil e apresenta objetivo de retorno de CDI+5-6% a.a. no longo prazo, com volatilidade-alvo de 7-8% a.a.

AZ QUEST MULTI MAX FIC FIM

Lançado em 2017, é um fundo multimercado com estratégia macro, isto é, suas teses de investimento são baseadas na elaboração de cenários macroeconômicos, que dão suporte para a escolha de classes de ativos específicas e culminam com a montagem de posições dentro do fundo. A tomada das decisões de investimento para o fundo é feita de forma colegiada, com uma abordagem de investimentos que combina análises bottom-up e top-down. Com foco em ativos predominantemente locais, mas com exposição internacional, o fundo investe principalmente nos mercados de Juros Brasil, Juros Internacional, Moedas, Ações Brasil e Ações Internacional, podendo investir também, em menor proporção, nos mercados de Commodities. O fundo possui objetivo de retorno de CDI+7% ao ano no longo prazo com uma volatilidade esperada de 10% a.a. . A principal métrica de risco é o Stress. O fundo não apresenta o mecanismo de stop loss por gestor, nem para o fundo como um todo.

DISCLAIMER

"As informações contidas neste documento são confidenciais, sendo exclusivamente para o uso do(s) seu (s) destinatário (s). Esteja ciente de que estão expressamente proibidas, sem qualquer exceção, modificar, copiar, transmitir, distribuir, expor, desenvolver, reproduzir, publicar, licenciar, copiar formato, criar trabalhos derivados, transferir ou de outra forma utilizar, no todo ou em parte, para sem prévia e expressa autorização, por escrito, da mesa de Investment Solutions.

Este material foi elaborado pela mesa de Investment Solutions ("IS") e seus representantes e não configura um relatório de análise de valores mobiliários. As informações, prazos, taxas e condições aqui contidas são meramente indicativas e informativas, e não constituem ou devem ser interpretadas como uma oferta ou solicitação de compra ou venda de qualquer instrumento financeiro ou de participação em qualquer estratégia de negócios específica , qualquer que seja a jurisdição. Qualquer informação contemplada neste material deve ser confirmada quanto às suas condições, previamente à conclusão de qualquer negócio. A IS não declara ou garante, de forma expressa ou implícita, a integridade, confiabilidade ou exatidão de tais informações.

Uma vez que as opiniões pessoais dos analistas de investimentos e demais representantes da IS podem ser divergentes entre si , IS pode ter publicado ou poderá vir a publicar outros relatórios que não apresentem uniformidade e/ ou cheguem a diferentes conclusões em relação às informações fornecidas neste material.

Os instrumentos financeiros discutidos neste material podem não ser adequados para todos os investidores. Este material não leva em consideração os objetivos de investimento, situação financeira ou necessidades específicas de qualquer investidor. Os investidores devem obter orientação financeira independente, com base em suas características pessoais, antes de tomar uma decisão de investimento baseada nas informações contidas neste material. Caso um instrumento financeiro seja expresso em uma moeda que não a do investidor, uma alteração nas taxas de câmbio pode impactar adversamente o preço, valor ou rentabilidade do instrumento financeiro e o leitor deste material assume quaisquer riscos de câmbio. Os desempenhos anteriores não são necessariamente indicativos de resultados futuros, e nenhuma declaração ou garantia, de forma expressa ou implícita, é feita neste material em relação a desempenhos futuros. A XPA se exime de qualquer responsabilidade por quaisquer prejuízos, diretos ou indiretos, que venham a decorrer da utilização deste material ou seu conteúdo.

A rentabilidade de produtos financeiros pode apresentar variações e seu preço ou valor pode aumentar ou diminuir num curto espaço de tempo. Os desempenhos anteriores não são necessariamente indicativos de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. As informações presentes neste material são baseadas em simulações e os resultados reais poderão ser significativamente diferentes.

O investimento em ações é indicado para investidores de perfil moderado, moderado agressivo e agressivo, de acordo com a política de suitability praticada pela XP Investimentos. Ação é uma fração do capital de uma empresa que é negociada no mercado. É um título de renda variável, ou seja, um investimento no qual a rentabilidade não é preestabelecida, dependendo das cotações nos mercados. O investimento em ações é um investimento de alto risco e os desempenhos anteriores não são necessariamente indicativos de resultados futuros e nenhuma declaração ou garantia, de forma expressa ou implícita, é feita neste material em relação a desempenhos. As condições de mercado, o cenário macroeconômico, os eventos específicos da empresa e do setor podem afetar o desempenho do investimento, podendo resultar até mesmo em significativas perdas patrimoniais. A duração recomendada para o investimento é de médio longo prazo. O patrimônio do cliente não está garantido neste tipo de produto.

O investimento em opções é preferencialmente indicado para investidores de perfil moderado agressivo e agressivo, de acordo com a política de suitability praticada pela XP Investimentos. No mercado de opções, são negociados direitos de compra ou venda de um bem por preço fixado em data futura, devendo o adquirente do direito negociado pagar um prêmio ao vendedor tal como num acordo seguro. As operações com esses derivativos são consideradas de risco muito alto por apresentarem altas relações de risco e retorno e algumas posições apresentarem a possibilidade de perdas superiores ao capital investido . A duração recomendada para o investimento é de curto prazo e o patrimônio do cliente não está garantido neste tipo de produto.

O investimento em termos é preferencialmente indicado para investidores de perfil moderado agressivo e agressivo, de acordo com a política de suitability praticada pela XP Investimentos. São contatos para compra ou a venda de uma determinada quantidade de ações, a um preço fixado, para liquidação em prazo determinado. O prazo do contrato a Termo é livremente escolhido pelos investidores, obedecendo o prazo mínimo de 16 dias e máximo de 99 dias corridos. O preço será o valor da ação adicionado de uma parcela correspondente aos juros que são fixados livremente em mercado, em função do prazo do contrato. Toda transação a termo requer um depósito de garantia. Essas garantias são prestadas em duas formas: cobertura ou margem.

O investimento em commodities é preferencialmente indicado para investidores de perfil moderado agressivo e agressivo, de acordo com a política de suitability praticada pela XP Investimentos. Commodity é um objeto ou determinante de preço de um contrato futuro ou outro instrumento derivativo, podendo consubstanciar um índice, uma taxa, um valor mobiliário ou produto físico. É um investimento de risco muito alto, que contempla a possibilidade de oscilação de preço devido à utilização de alavancagem financeira. A duração recomendada para o investimento é de curto prazo e o patrimônio do cliente não está garantido neste tipo de produto. As condições de mercado, mudanças climáticas e o cenário macroeconômico podem afetar o desempenho do investimento

Fundo de investimento é uma comunhão de recursos, captados de pessoas físicas ou jurídicas, com o objetivo de obter ganhos financeiros a partir da aplicação em títulos e valores mobiliários. Um fundo é organizado sob a forma de condomínio e seu patrimônio é dividido em cotas, cujo valor é calculado diariamente por meio da divisão do patrimônio líquido pelo número de cotas em circulação.

LEIA O PROSPECTO, O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. FU NDO S DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO FGC. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REP RESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADES FUTURA. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. AS INFORMAÇÕES PRESENTES NESTE MARERIAL TÉCNICO SÃO BASEADAS EM SIMULAÇÕES E OS RESULTADOS REAIS PODERÃO SER SIGNIFICATIVAMENTE DIFERENTES."

Autorregulação ANBIMA
Private

xp private