

Objetivo do Fundo

Obter retornos significativos acima do IPCA+Y no longo prazo, potencialmente descorrelacionados do desempenho do mercado, utilizando estratégias quantitativas executadas de forma sistemática.

Política de Investimentos

Consiste em aplicar no mínimo 95% de suas cotas no ENTERCAPITAL PASCAL LONG BIAS FIC FIA, que busca através de estratégias sistemáticas e quantitativas, gerar retorno acima do IPCA+Y, de maneira descorrelacionada, através da construção de um portfólio diversificado.

Os ativos são negociados nos mercados de renda fixa, renda variável, commodities, moedas e derivativos, locais e internacionais, sempre sob uma perspectiva de preservação de capital e pela busca de oportunidades de médio e longo prazos, através da identificação de novas estratégias quantitativas. O fundo sempre fica com 67% do seu patrimônio líquido posicionado em ativos de renda variável.

Recomenda-se a leitura atenta do regulamento do fundo.

Informações Gerais

Administrador
BEM DTVM

Gestor
EnterCapital Gestão de Recursos Ltda

Custódia
BEM DTVM

Público Alvo
Investidor Qualificado

Auditor
Pricewaterhousecoopers

Taxa de Administração
1.485%

Aplicação Inicial
R\$ 100.00

Movimentação Mínima
R\$ 100.00

Saldo Mínimo de Permanência
R\$ 100.00

Horário de Movimentação
12:30

Início do Fundo
29/dez/21

Início da Atual Gestão
29/dez/21

Categoria Anbima
Long Bias

Cota
Fechamento

Tributação
Fundo de Ações

Taxa de Performance
20%

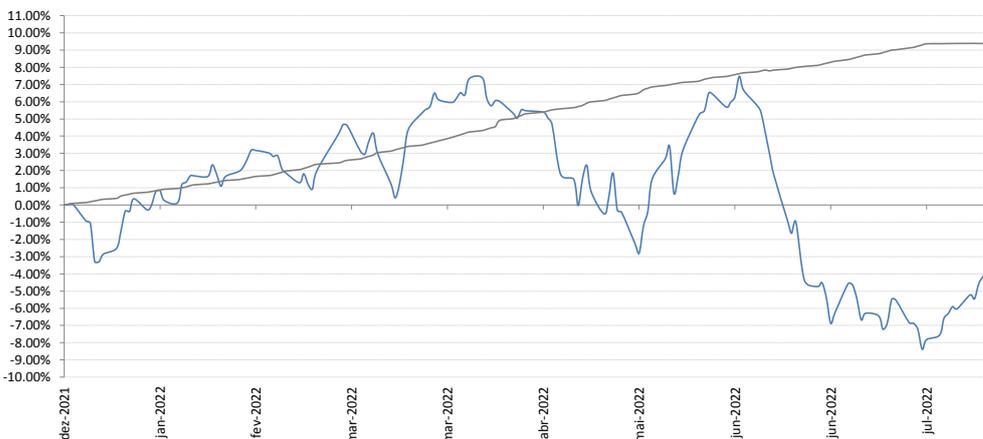
Aplicação - Cotização
D+1 dia útil após a data de aplicação

Solicitação de Resgate
A qualquer momento (sem carência)

Resgate - Cotização
D+30 dias corridos

Resgate - Pagamento
D+2 dias úteis após a data de cotização

Gráfico de Rentabilidade - ENTERCAPITAL PASCAL LONG BIAS FIC FIA



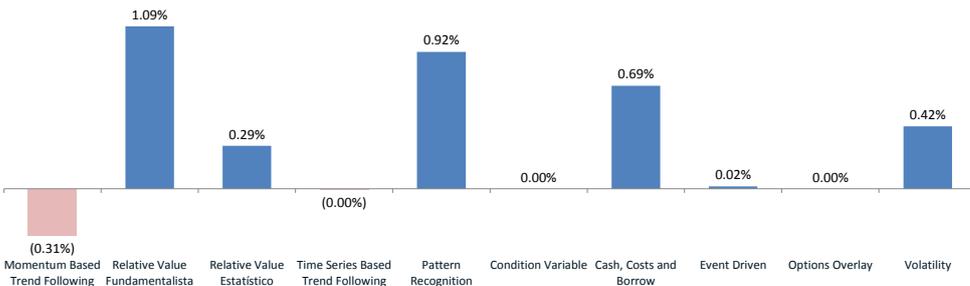
Estatísticas

PL atual Fundo Master	R\$ 12,225,279
PL do Fundo em 29/jul/2022	R\$ 9,797,904
PL médio desde o início	R\$ 7,161,290
Retorno Acumulado	-3.77%
CDI Acumulado	9.38%
Retorno Médio Mensal	-0.08%
Volatilidade anualizada	15.33%
Sharpe	-0.31
Número de meses negativos	2
Número de meses positivos	6
Número de meses abaixo do IPCA+Y	4
Número de meses acima do IPCA+Y	4
Maior rentabilidade mensal	5.15%
Menor rentabilidade mensal	-11.92%

Correlação de 12 meses

Ibovespa	0.92
Dólar	-0.53
IMA-B	0.08
Pré - 1Y	0.16
Índice de Hedge Funds (IHFA)	0.62

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2022	Fundo	1.62%	0.32%	4.32%	(5.27%)	5.15%	(11.92%)	3.10%	-	-	-	-	-	(3.81%)	(3.77%)
	IPCA+Y	1.13%	1.13%	1.75%	1.76%	1.44%	1.05%	0.68%	-	-	-	-	-	9.28%	9.39%
	CDI+	0.49%	(0.81%)	2.56%	(7.03%)	3.71%	(12.97%)	2.42%	-	-	-	-	-	(13.09%)	(13.16%)
2021	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.04%	0.04%	0.04%
	IPCA+Y	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.10%	0.10%	0.10%
	CDI+	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(0.06%)	-0.06%	-0.06%



Contribuição Classe de Estratégia em JUL/2022

Momentum Based Trend Following	(0.31%)
Relative Value Fundamentalista	1.09%
Relative Value Estatístico	0.29%
Time Series Based Trend Following	(0.00%)
Pattern Recognition	0.92%
Condition Variable	0.00%
Cash, Costs and Borrow	0.69%
Event Driven	0.02%
Options Overlay	0.00%
Volatility	0.42%
Total	3.11%

CONTATO COMERCIAL

Artur Ignarra
+55 (11) 2372-1391
artur@entercapital.com.br

EnterCapital Gestão de Recursos | www.entercapital.com.br
Rua George Ohm, 206, 74A | São Paulo - SP | CEP 04576-020
Tel: +55 11 2372-1391 | contato@entercapital.com.br



As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Regulamento do fundo, disponível em www.entercapital.com.br/fundos. As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada. A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de resgate antecipado. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo fundo garantidor de crédito (FGC). Leia a lâmina de informações essenciais e o regulamento do fundo antes de investir.