

INFORMAÇÕES

PÚBLICO ALVO

O FUNDO tem como público alvo investidores em geral

CATEGORIA ANBIMA

Multimercados Livre

GESTOR

Dahlia Capital Gestão de Recursos Ltda.

ADMINISTRADOR

BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.

CUSTODIANTE

BNY Mellon Banco S.A.

INFORMAÇÕES GERAIS

CNPJ: 30.317.454/0001-51
Data de início: 30/05/2018

Fundo ABERTO para
Captação

MOVIMENTAÇÕES

Cota de aplicação: D+1
Aplicação inicial mínima:
R\$ 500,00
Saldo mínimo: R\$100,00
Horário de movimentação:
até as 14:00hrs

RESGATES

Cota de resgate: D+30
Pagamento: 2º dia útil
subsequente à data de
conversão

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

1.85% a.a. (+0.15% a.a. no
fundo MASTER)

TAXA DE PERFORMANCE

20% da valorização das
cotas do Fundo que exceder
a 100% da variação do IPCA
(Índice de Preços ao Consumidor Amplo), acrescido da
média ponderada das taxas
dos títulos que compõe o
IMA-B (Índice de Mercado
Anbima indexado ao IPCA)

TRIBUTAÇÃO

IR: Imposto de 15% cobrados
exclusivamente no resgate.
Não há come cotas

O FUNDO

O FUNDO utiliza-se de análise fundamentalista para seleção dos ativos, tendo como objetivo retorno absoluto. Analisamos a estrutura de capital das empresas na região buscando arbitragem entre a ação na bolsa e a dívida corporativa, visando alocar capital de forma eficiente (maior retorno com menor risco) dado leque mais amplo de oportunidades. Complementamos a composição de nossa carteira com derivativos de ações, de moedas e de renda fixa, de forma a buscar proteção e controlar o nível de risco da mesma.

RENTABILIDADE MENSAL¹

| | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Ano | Acum. ² | |
|------|------------------------|--------|--------|---------|-------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|-------|--------------------|--------|
| 2021 | Fundo | -0,38% | -0,36% | 0,15% | 1,31% | - | - | - | - | - | - | - | 0,71% | 84,94% | |
| | Benchmark ³ | 1,04% | 0,53% | 1,41% | 0,74% | - | - | - | - | - | - | - | 3,77% | 25,65% | |
| | %Benchmark | - | - | 11% | 177% | - | - | - | - | - | - | - | - | 19% | 331% |
| | CDI | 0,15% | 0,13% | 0,20% | 0,21% | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,69% | 13,68% |
| | %CDI | - | - | 76% | 632% | - | - | - | - | - | - | - | - | 103% | 621% |
| 2020 | Fundo | 1,86% | -5,26% | -13,56% | 9,86% | 4,78% | 6,32% | 5,49% | 1,62% | -2,27% | 0,50% | 4,71% | 4,84% | 17,99% | 83,63% |
| | Benchmark ³ | 1,02% | 0,28% | 0,54% | 0,18% | -0,17% | 0,19% | 0,50% | 0,45% | 0,58% | 1,01% | 0,99% | 1,34% | 7,11% | 21,08% |
| | %Benchmark | 183% | - | - | 5478% | - | 3394% | 1091% | 363% | - | 49% | 476% | 361% | 253% | 397% |
| | CDI | 0,38% | 0,29% | 0,34% | 0,28% | 0,24% | 0,22% | 0,19% | 0,16% | 0,16% | 0,16% | 0,15% | 0,16% | 2,77% | 12,91% |
| | %CDI | 494% | - | - | 3462% | 2026% | 2843% | 2823% | 1011% | - | 318% | 3153% | 2944% | 650% | 648% |
| 2019 | Fundo | 9,08% | 0,11% | 0,84% | 0,78% | 0,20% | 3,85% | 2,76% | 1,32% | 1,03% | 2,69% | 2,11% | 7,01% | 36,29% | 55,63% |
| | Benchmark ³ | 0,65% | 0,59% | 0,81% | 1,09% | 0,71% | 0,25% | 0,42% | 0,41% | 0,30% | 0,22% | 0,44% | 1,05% | 7,17% | 13,03% |
| | %Benchmark | 1389% | 18% | 103% | 71% | 28% | 1539% | 663% | 324% | 338% | 1228% | 480% | 665% | 506% | 427% |
| | CDI | 0,54% | 0,49% | 0,47% | 0,52% | 0,54% | 0,47% | 0,57% | 0,50% | 0,46% | 0,48% | 0,38% | 0,37% | 5,97% | 9,87% |
| | %CDI | 1673% | 22% | 179% | 150% | 37% | 822% | 486% | 262% | 222% | 561% | 554% | 1872% | 608% | 564% |
| 2018 | Fundo | - | - | - | - | - | -0,12% | 4,47% | -0,09% | -0,71% | 8,10% | 1,26% | 0,80% | 14,19% | 14,19% |
| | Benchmark ³ | - | - | - | - | - | 1,28% | 1,25% | 0,64% | 0,49% | 0,99% | 0,48% | 0,22% | 5,47% | 5,47% |
| | %Benchmark | - | - | - | - | - | - | 357% | - | - | 816% | 264% | 358% | 259% | 259% |
| | CDI | - | - | - | - | - | 0,52% | 0,54% | 0,57% | 0,47% | 0,54% | 0,49% | 0,49% | 3,68% | 3,68% |
| | %CDI | - | - | - | - | - | - | 824% | - | - | 1492% | 255% | 162% | 385% | 385% |

¹Rentabilidade líquida de taxas de administração e performance e bruta de impostos

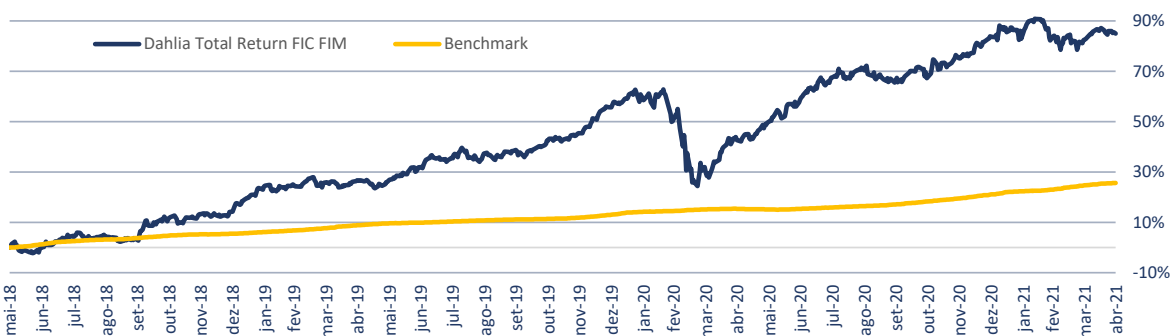
²Data de início do fundo: 30/05/2018

³Benchmark: IPCA + média ponderada das taxas de títulos que compõe o IMA-B (Índice de Mercado Anbima Indexado ao IPCA)

⁴O CDI é mera referência econômica e não parâmetro objetivo do fundo

Fonte: Dahlia Capital

RENTABILIDADE ACUMULADA



Fonte: Dahlia Capital

DESEMPENHO

| | Fundo | Benchmark |
|-----------------------------|-------------------------------|--------------|
| Rentabilidade 12 Meses | 29,67% | 8,93% |
| Maior Rentabilidade Mensal | 9,86% | 1,41% |
| Menor Rentabilidade Mensal | -13,56% | -0,17% |
| Volatilidade Anualizada 12M | 12,23% | 0,50% |
| Índice de Sharpe Anualizado | Benchmark CDI ⁴ | 1,66 2,00 |

Fonte: Dahlia Capital

⁴O CDI é mera referência econômica e não parâmetro objetivo do fundo

Dahlia Capital Gestão de Recursos Ltda.

Rua Joaquim Floriano, 940, cj. 21 | São Paulo – SP | 04534-004
(11) 4118-3148 / 4118-3146 | contato@dahliacapital.com.br

A Dahlia Capital não se responsabiliza por decisões do investidor, nem por ato ou fato de profissionais especializados por ele consultados. O investidor deve se basear, exclusivamente, em sua opinião e na opinião de profissionais especializados por ele contratados, para opinar e decidir. Este material não pode ser reproduzido, copiado ou distribuído para terceiros, total ou parcialmente, sem a expressa concordância da Dahlia Capital. Esta apresentação não se caracteriza nem deve ser entendida como uma promessa ou um compromisso da Dahlia Capital de realizar as operações ou estruturar os veículos de investimento aqui descritos. Esta apresentação não se caracteriza e não deve ser entendida como consultoria jurídica, contábil, regulatória ou fiscal em relação aos assuntos aqui tratados. Este material é meramente informativo, não considera objetivos de investimento, situação financeira ou necessidades individuais e particulares e não contém todas as informações que um investidor em potencial deve considerar ou analisar antes de investir. Não deve ser entendido como análise de valor mobiliário, material promocional, solicitação de compra ou venda, oferta ou recomendação de qualquer ativo financeiro ou investimento e não configura sugestão ou consultoria jurídica. A Dahlia Capital não se responsabiliza por erros, omissões ou pelo uso das informações contidas neste material.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO

| | Fundo |
|-------------------------------------|----------------------|
| Patrimônio Líquido Atual | FIC 1.894.908.197 |
| | Master 8.897.043.885 |
| Patrimônio Líquido Médio - 12 Meses | FIC 1.450.610.003 |
| | Master 6.352.652.633 |

Fonte: Dahlia Capital

BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM SA

Av. Presidente Wilson, 231, 11º andar | Rio de Janeiro – RJ | 20030-20
(21) 3974-4500 | clientservice@mellonbrasil.com.br

