

ASA ALPHA NOMINAL RATES FI RF

Dezembro 2022



OBJETIVO

O ASA Alpha Nominal Rates atua prioritariamente no mercado de juros pre-fixados. Com o objetivo de superar o IRF-M no longo prazo, o fundo pode adotar posições ativas tanto no mercado de juros nominais quanto reais, explorando oportunidades decorrentes das assimetrias de preços e da evolução dos fundamentos econômicos.

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O ASA Alpha Nominal Rates realiza operações nas classes de juros nominais e reais, podendo adotar estratégias de duration management, seleção de títulos e valor relativo, utilizando-se dos instrumentos de renda fixa disponíveis nos mercados à vista e de derivativos.

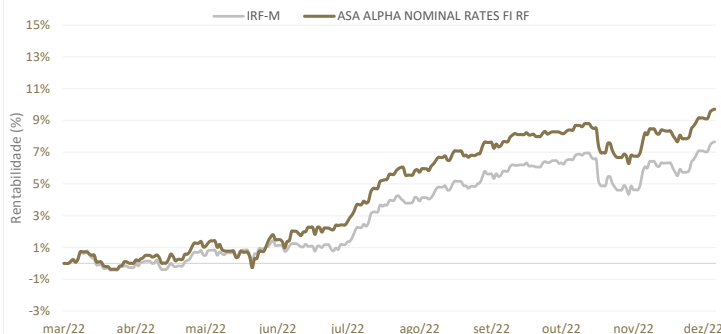
PÚBLICO ALVO

Investidores em geral.

INDICADORES

| | |
|---|----------------|
| Patrimônio Líquido | R\$ 13.164.798 |
| Patrimônio Líquido (média desde a constituição) | R\$ 12.533.925 |
| Volatilidade (desde a constituição) | 3,88% |
| Information Ratio (desde a constituição) | 1,47 |
| Meses Positivos | 8 |
| Meses Negativos | 1 |
| Maior Retorno Mensal | 2,47% |
| Menor Retorno Mensal | -0,42% |

RENTABILIDADE ACUMULADA



Fonte: ASA Investments

Período dos dados: 25/03/2021 a 30/12/2022

RENTABILIDADE DO FUNDO E RETORNO IRF-M (MENSAL)

| ANO | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | ANO | INÍCIO |
|------|-----|-----|-------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|-------|--------|
| 2022 | | | 0,26% | 0,24% | 0,69% | 0,23% | 2,23% | 2,47% | 1,32% | 0,94% | -0,42% | 1,38% | 9,71% | 9,71% |
| | | | 0,00% | 0,36% | 0,11% | -0,13% | 1,07% | 0,41% | -0,08% | 0,02% | 0,23% | -0,10% | 1,91% | 1,91% |

RENTABILIDADE DO FUNDO E RETORNO DO IRF-M (PERÍODO)

| | MÊS | ANO | 6 MESES | 12 MESES | 24 MESES | 36 MESES | INÍCIO |
|-------------------------|---------|-------|---------|----------|----------|----------|--------|
| ASA ALPHA NOMINAL RATES | 1,38% | 9,71% | 8,16% | - | - | - | 9,71% |
| acima IRF-M | (0,10%) | 1,91% | 1,56% | - | - | - | 1,91% |

* Rentabilidade acumulada e calculada desde o início do fundo, a partir de 25/03/2022.

INFORMAÇÕES GERAIS

| | | | |
|-----------------------|--------------------------|----------------------------------|---|
| Início das Atividades | 25/03/2022 | CNPJ | 44.917.343/0001-90 |
| Público-alvo | Investidores em geral | Classificação ANBIMA | Renda Fixa / Duração Livre / Grau de Investimento |
| Taxa de Administração | 0,50% | Aplicação Mínima | R\$ 10.000 |
| Taxa de Performance | Não há | Movimentação Mínima | R\$ 5.000 |
| Taxa de Saída | Não há | Saldo Mínimo | R\$ 5.000 |
| Tributação IR* | Fundos de Longo Prazo | Horário Limite para Movimentação | 14:30h |
| Administrador | BEM DTVM | Aplicação | Cotização em D+0 |
| Custodiante | Banco Bradesco | Resgate | Cotização em D+0 e Liquidação em D+1 |
| Auditor Independente | Deloitte Touche Tohmatsu | Resgate Antecipado | Não se aplica |

contato@asainvestments.com.br

(11) 3900-5181

Alameda Santos, 2159, Cj 52, Consolação, São Paulo, SP

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo, não se caracterizando como oferta ou solicitação de investimento em ativos financeiros pela Asset 2 Gestão de Recursos LTDA. ("ASA Investments"), tampouco, recomendação para compra ou venda de cotas do Fundo, cujas características poderão ou não se enquadrar ao perfil do investidor, nos termos da Resolução CVM 30/21. Antes de investir, leia o regulamento, o prospecto, a lâmina de informações essenciais, o formulário de informações complementares e os demais materiais relacionados ao Fundo que estão disponíveis no website do Administrador (<https://bemdtvm.bradesco/> / <https://bemdtvm.bradesco/html/bemdtvm/shareholders-information.shtml>). Informações relativas aos horários, valores máximos e mínimos de aplicação e movimentação, prazo de carência, conversão e liquidação para movimentações, taxas de administração, performance, entrada e saída cabíveis ao Fundo, tratamento tributário perseguido, descrição e objetivos de investimento, utilização de derivativos, aquisição de ativos negociados no exterior, concentração de poucos emissores de ativos de renda variável, principais fatores de risco, dentre outras informações poderão ser adquiridas em documentos específicos, tais como, regulamento e lâminas do Fundo, disponíveis em <https://www.asainvestments.com>. Mesmo com todo o cuidado em sua coleta e manuseio, a ASA Investments não se responsabiliza por erros, omissões ou imprecisões no conteúdo das informações divulgadas, nem por decisões de investimento tomadas com base neste documento, seja pelo investidor ou por profissionais por ele consultados e/ou contratados. Algumas das informações aqui contidas podem ter sido obtidas de fontes de mercado. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito – FGC. *Não há garantia de que o Fundo terá tratamento tributário de longo prazo. Este Fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Este Fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimentos. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. A ASA Investments está devidamente autorizada pela Comissão de Valores Mobiliários para o exercício da atividade de administração de carteiras de valores mobiliários. O conteúdo deste material não pode ser copiado, reproduzido, publicado, retransmitido ou distribuído, no todo ou em parte, por qualquer meio e modo, sem a prévia e expressa autorização, por escrito, da ASA Investments.

