

CLAVE ALPHA MACRO II FIC FIM

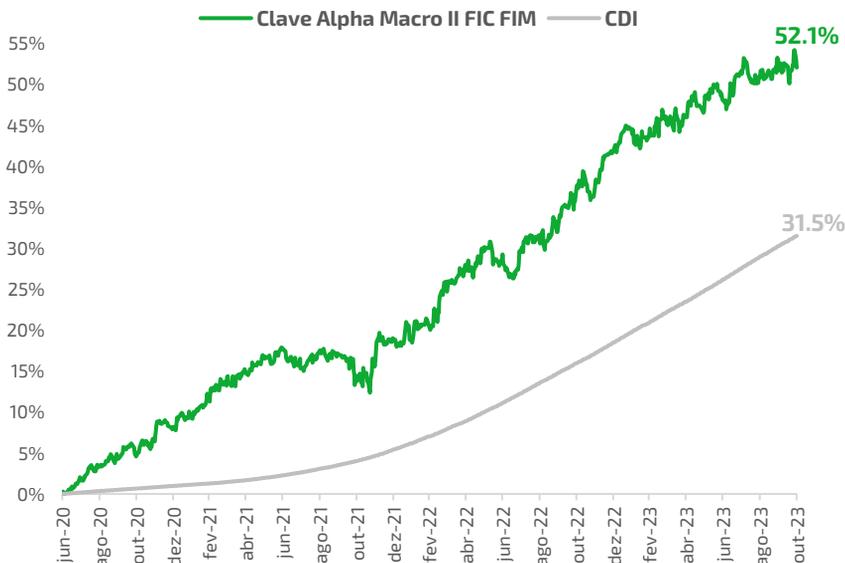
OBJETIVO DE INVESTIMENTO

O CLAVE ALPHA MACRO II FIC FIM (CNPJ: 41.610.584/0001-02) tem como objetivo aplicar seus recursos em cotas do CLAVE ALPHA MACRO MASTER FIM (CNPJ: 19.941.720/0001-80), cuja política de investimento consiste em buscar atingir retornos superiores ao CDI por meio da utilização de um processo de investimento disciplinado e diversificado, com base em análise macroeconômica.

Multimercado Macro de nicho, com DNA de operar estratégias direcionais e de valor relativo, com agilidade e flexibilidade.

Foco em diversificação, boa gestão de risco, e amplitude de instrumentos e fontes de alfa.

RENTABILIDADE ACUMULADA¹



¹ Dados calculados entre 30/06/2020 e 04/01/2022 com base nas cotas do veículo Clave Alpha Macro FIC FIM (CNPJ: 37.319.496/0001-70), e a partir desta data, com base no fundo Clave Alpha Macro II FIC FIM ("Fundo" - CNPJ: 41.610.584/0001-02), que teve início em 04 de janeiro de 2022, fruto de uma cisão do Clave Alpha Macro FIC FIM, considerando o fechamento de 31/10/2023.

INDICADORES¹

| | |
|--|---------|
| RENTABILIDADE DESDE O INÍCIO (FUNDO) | 52.07% |
| RENTABILIDADE DESDE O INÍCIO (CDI) | 31.53% |
| RENTABILIDADE EM 12 MESES (FUNDO) | 10.47% |
| RENTABILIDADE EM 12 MESES (CDI) | 13.42% |
| VOLATILIDADE ANUALIZADA | 6.60% |
| SHARPE | 0.73 |
| NÚMERO DE MESES POSITIVOS | 31 |
| NÚMERO DE MESES NEGATIVOS | 9 |
| MAIOR RENTABILIDADE MENSAL | 3.78% |
| MENOR RENTABILIDADE MENSAL | -2.25% |
| PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL (R\$MI) | 536.4 |
| PATRIMÔNIO MÉDIO EM 12 MESES (R\$MI) | 449.4 |
| PATRIMÔNIO LÍQUIDO DA ESTRATÉGIA (R\$MI) | 5,496.9 |

RENTABILIDADES (%)²

| | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | ANO FUNDO | ANO CDI | ACUM. FUNDO | ACUM. CDI |
|------|--------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|-----------|---------|-------------|-----------|
| 2020 | | | | | | | 1.68% | 1.73% | 0.80% | 0.31% | 1.74% | 1.69% | 8.20% | 0.99% | 8.20% | 0.99% |
| 2021 | 1.05% | 2.22% | 2.38% | 0.29% | 1.54% | 1.13% | -2.13% | 1.94% | -0.37% | -2.25% | 0.94% | 2.89% | 9.89% | 4.40% | 18.89% | 5.43% |
| 2022 | -0.34% | 2.33% | 3.38% | 2.09% | 1.70% | -0.68% | 0.19% | 0.84% | 1.58% | 3.78% | -0.18% | 3.23% | 19.31% | 12.37% | 41.85% | 18.47% |
| 2023 | 1.50% | -0.04% | 0.77% | 0.81% | 0.83% | 0.49% | 2.37% | -0.53% | 1.61% | -0.78% | | | 7.21% | 11.02% | 52.07% | 31.53% |

² Rentabilidade líquida de administração e performance e bruta de impostos. Dados calculados entre 30/06/2020 e 04/01/2022 com base nas cotas do veículo Clave Alpha Macro FIC FIM (CNPJ: 37.319.496/0001-70), e a partir desta data, o retorno foi calculado com base no fundo Clave Alpha Macro II FIC FIM ("Fundo" - CNPJ: 41.610.584/0001-02), que teve início em 04 de janeiro de 2022, fruto de uma cisão do Clave Alpha Macro FIC FIM, considerando o fechamento de 31/10/2023.

INFORMAÇÕES GERAIS

Data de Início¹
04/01/2022

Aplicação Inicial Mínima
R\$ 500.00

Cota de Aplicação
D+1 até às 15h

Taxa de Administração
2.00% (incluindo a taxa do fundo Master)

Gestor
Clave Capital

Status
Aberto para aplicações

Movimentação Mínima
R\$ 100.00

Cota de Resgate
D+30

Taxa de Performance
20% do que exceder 100% do CDI (Semestral)

Administrador
Intrag DTM Ltda.

Classificação Anbima
Multimercado Macro

Saldo Mínimo
R\$ 100.00

Liquidação do resgate
1º dia útil após cotização

Taxa de Saída
10%, com cotização em D+5 e pagamento em D+1

Custodiante
Itaú Unibanco S.A.

Público Alvo
Investidor Qualificado

Horário
9h00 às 15h

Dados Bancários
Banco Itaú (341) – Ag. 8541
C/C 52742-3

Tributação
O fundo perseguirá o tratamento de longo prazo.

Auditoria
Deloitte Touche
Tohmatsu

O fundo Clave Alpha Macro II FIC FIM ("Fundo" - CNPJ: 41.610.584/0001-02) teve início em 04 de janeiro de 2022, fruto de uma cisão do Clave Alpha Macro FIC FIM (CNPJ: 37.319.496/0001-70). Em 30 de junho de 2021, houve a mudança da gestão do Clave Alpha Macro FIC FIM ("Fundo"), passando a Clave Gestora de Recursos Ltda. ("Clave Capital") a ser a gestora responsável pelo Fundo, com a consequente alteração de sua denominação. As informações contidas neste material de divulgação ("Material") têm caráter exclusivamente informativo e não constituem qualquer tipo de aconselhamento, consultoria, análise ou oferta de valores mobiliários, não devendo, portanto, ser utilizadas com este propósito. A Clave Capital não realiza distribuição de cotas. Para investir em nossos fundos, contate um distribuidor autorizado. OS INVESTIMENTOS EM FUNDOS NÃO SÃO GARANTIDOS PELO ADMINISTRADOR, PELO GESTOR OU POR QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, PELO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC. A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RESULTADOS FUTUROS. Os fundos da Clave Capital podem utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento; tais estratégias, da forma como são adotadas, 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. Não há garantia de que os fundos da Clave Capital terão o tratamento tributário para fundos de longo prazo. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS E TAXA DE SAÍDA. Recomenda-se a análise mínima de 12 (doze) meses para a avaliação de performance de fundos de investimento. Fonte dos índices de referência: www.b3.com.br/pt_br/leia_a_lamina_de_informacoes_essenciais_e_o_regulamento_antes_de_tomar_sua_decisao_de_investimento, ESPECIALMENTE A SEÇÃO RELATIVA AOS FATORES DE RISCO, E CONSULTE SEUS PRÓPRIOS ASSESSORES JURÍDICOS E/OU FINANCEIROS. Esses documentos podem ser consultados no seguinte endereço eletrônico: <http://www.intrag.com.br/intrag-pt/pesquisa/>, Ouvidoria Corporativa Itaú (0800 570 0011), em dias úteis, das 9 às 18 horas, Caixa Postal 67 600, CEP 03312-971. Deficientes auditivos ou de fala, dias úteis, das 9 às 18 horas, 0800 722 1722. Supervisão e Fiscalização: Comissão de Valores Mobiliários - CVM. Serviço de Atendimento ao cidadão em www.cvm.gov.br. MAIORES INFORMAÇÕES SOBRE A CLAVE CAPITAL ESTÃO DISPONÍVEIS NO SITE: www.clavecapital.com.br.



São Paulo: Av. Brigadeiro Faria Lima 3144, Cj 132 | Jardim Paulistano | CEP: 01451-000

Tel: 55 11 3181-2312

/clave.capital

Rio de Janeiro: Av. Afrânio de Melo Franco 290 | Leblon Executive Tower | CEP: 22430-060

www.clavecapital.com.br

Clave Capital