

11 . a b r . 2 0 2 4

LVNT



Melhores e piores desempenhos dos multimercados

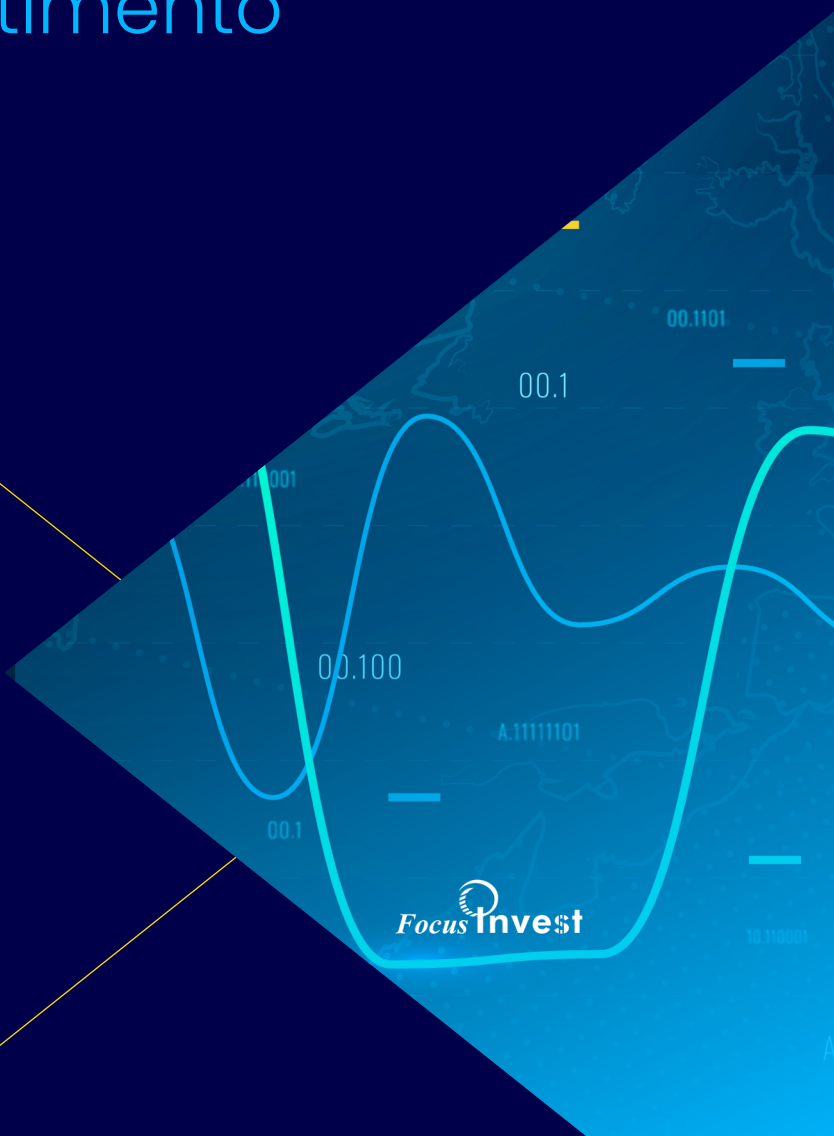
Fundo de Investimento



Analista
Eduardo Rahal
CNPI-T 2947



Analista
Luiz Gustavo



Fundo de Investimento

Melhores e piores desempenhos dos multimercados

Este relatório destaca os desempenhos classificados como multimercado na CVM com melhor e pior desempenho em diferentes janelas de tempo. Ao todo, a pesquisa foi realizada com 1.486 estratégias de diversas classes, disponíveis nas principais corretoras e distribuidoras nacionais, incluindo XP, BTG e Itaú na relação. Foram então analisados 712 desempenhos classificados como Multimercado pela CVM. Excluímos desempenhos com menos de 6 meses de existência, com patrimônio líquido inferior a R\$ 10 milhões, com apenas 1 cotista, e indexados de gestão passiva. A data de referência da pesquisa é 28/03/2024. Essa pesquisa não aborda todos os desempenhos da indústria.

Melhores desempenhos em 36 meses

CNPJ	Fundo	Início	Retorno 2024	Retorno 12 Meses	%CDI 12 meses	Sharpe 12 meses	Volatilidade 12 meses	Perda máxima 12 meses
24.623.392/0001-03	Guepardo Long Bias FI MM LP	11/07/2016	6,640902925	61,08888425	4,896371443	3,889615578	12,57618019	3,309847743
30.887.013/0001-95	Versa Tracker FI MM	27/08/2018	-10,81623698	50,69271595	4,063101982	1,123113361	34,24222291	28,12812701
18.832.847/0001-06	Versa Long Biased FI MM	28/10/2013	-5,873532001	39,559806	3,170781505	0,574650721	47,43424515	45,31502563
17.453.850/0001-48	Western Asset Us Index 500 FI MM	30/04/2013	11,07078452	38,62168018	3,095589226	2,277554724	11,55377856	8,775069946
37.495.383/0001-26	Genoa Capital Arpa FICFI MM	30/04/2021	13,46685496	38,36784564	3,075243983	1,733569424	15,03199323	12,18692099
07.013.315/0001-12	Polo Norte I Long Short FICFI MM	05/10/2004	0,572551606	38,19832984	3,061657021	1,624987615	15,93148753	10,59226033
35.779.895/0001-99	Vitis Capital Long Biased FICFI MM	10/03/2020	-4,690508155	38,02133355	3,047470486	1,19498454	21,51526628	15,57953396
29.574.952/0001-09	Versa Fit Long Biased FI MM	06/03/2018	-3,961906584	37,64536368	3,017335902	0,65049988	38,94263994	37,9520065
27.347.332/0001-01	Polo Long Bias I FICFI MM	04/10/2017	0,364776483	36,52520262	2,927553207	1,216024155	19,90527384	14,51965062
32.295.931/0001-50	Logos Long Biased FICFI MM	28/12/2018	2,285685129	34,76037886	2,78609977	0,977684161	22,94183673	16,16483557

Melhores desempenhos em 24 meses

CNPJ	Fundo	Início	Retorno 2024	Retorno 24 Meses	%CDI 24 meses	Sharpe 24 meses	Volatilidade 12 meses	Perda máxima 12 meses
39.800.501/0001-98	Bdr Avarga FI MM	15/12/2020	-11,15569313	170,7201193	6,231938148	2,973782378	32,25580204	25,04492148
19.628.666/0001-17	Exploritas ALPha America Latina FI Em Cotas de FI MM	30/04/2014	-0,093603549	12,06728252	0,967211928	-0,022954571	17,40490122	12,01052946
24.623.392/0001-03	Guepardo Long Bias FI MM LP	11/07/2016	6,640902925	61,08888425	4,896371443	3,889615578	12,57618019	3,309847743
35.002.927/0001-45	BTOp Aqr Long-Biased Equities FI Em Cotas de FI MM IE	20/02/2020	14,30757646	30,55639283	2,449143589	1,726697169	10,54072208	3,764540486
10.788.023/0001-66	Concórdia Harvest FI MM	11/05/2009	0,761008231	21,48307809	1,721902951	0,894260927	10,14561309	5,342286446
28.866.524/0001-89	Canvas Vector FICFI MM	19/12/2017	5,504251538	28,5038233	2,284626869	1,981510877	8,143148636	5,728992227
40.575.693/0001-65	Távola Equity Hedge 15 FI MM	05/02/2021	2,381860426	16,6073279	1,331103802	1,395636173	2,986302025	0,95181704
37.495.383/0001-26	Genoa Capital Arpa FICFI MM	30/04/2021	13,46685496	38,36784564	3,075243983	1,733568424	15,03199323	12,18692099
28.911.549/0001-57	Real Investor FICFI MM	02/01/2018	4,994839254	28,39570269	2,27596083	2,931356583	5,46742341	1,726400059
34.172.497/0001-47	Armor Axe FICFI MM	23/10/2019	7,306863225	18,97453638	1,520839334	1,348909524	4,855193834	2,475223035

Melhores desempenhos em 12 meses

CNPJ	Fundo	Início	Retorno 2024	Retorno 36 Meses	%CDI 36 meses	Sharpe 36 meses	Volatilidade 12 meses	Perda máxima 12 meses
39.800.501/0001-98	Bdr Avarga FI MM	15/12/2020	-11,15569313	99,94720627	2,817562541	0,963614897	32,25580204	25,04492148
19.628.666/0001-17	Exploritas ALPha America Latina FI Em Cotas de FI MM	30/04/2014	-0,093603549	12,06728252	0,967211928	-0,022954571	17,40490122	12,01052946
35.002.927/0001-45	BTOp Aqr Long-Biased Equities FI Em Cotas de FI MM IE	20/02/2020	14,30757646	30,55639283	2,449143589	1,726697169	10,54072208	3,764540486
24.623.392/0001-03	Guepardo Long Bias FI MM LP	11/07/2016	6,640902925	61,08888425	4,896371443	3,889615578	12,57618019	3,309847743
35.726.908/0001-61	Capstone Macro FICFI MM	31/03/2020	0,715787829	11,60915671	0,930492414	-0,186865814	4,604370132	1,860625077
34.172.497/0001-47	Armor Axe FICFI MM	23/10/2019	7,306863225	18,97453638	1,520839334	1,348909524	4,855193834	2,475223035
17.453.850/0001-48	Western Asset Us Index 500 FI MM	30/04/2013	11,07078452	38,62168018	3,095589226	2,277554724	11,55377856	8,775069946
28.558.421/0001-51	Kapitalo ALPha Global FICFI MM	07/11/2017	0,300266872	5,415088983	0,434028013	-1,180709325	6,006278512	3,80785103
28.911.549/0001-57	Real Investor FICFI MM	02/01/2018	4,994839254	28,39570269	2,27596083	2,931356583	5,46742341	1,726400059
40.575.693/0001-65	Távola Equity Hedge 15 FI MM	05/02/2021	2,381860426	16,6073279	1,331103802	1,395636173	2,986302025	0,95181704

Piores desempenhos em 36 meses

CNPJ	Fundo	Início	Retorno 2024	Retorno 36 Meses	%CDI 36 meses	Sharpe 36 meses	Volatilidade 12 meses	Perda máxima 12 meses
18.832.847/0001-06	Versa Long Biased FI MM	28/10/2013	-5,873532001	-43,8623187	-1,236501056	-0,776842478	47,43424515	45,31502563
38.001.966/0001-16	Mag Global Sustainable Fc de FI MM IE	14/10/2020	6,774057934	-34,16596619	-0,963155951	-1,63262312	17,72350585	17,71930029
23.960.625/0001-09	Safari 30 FICFI MM II	29/04/2016	-3,823080167	-32,86918671	-0,927162889	-1,535687688	23,90411111	24,35987981
24.454.718/0001-16	Jpmorgan Dolar Global Macro Op- portunities FI MM IE	17/05/2016	4,333788655	-20,89772221	-0,58911741	-1,978311739	14,33838964	16,67952904
30.887.013/0001-95	Versa Tracker FI MM	27/08/2018	-10,81623698	-20,29805361	-0,572212447	-0,670455221	34,24222291	28,12812701
23.872.712/0001-04	Western Asset Macro Opportunities Classe Dólar FI MM IE	05/08/2016	0,080035478	-19,18298314	-0,540778044	-1,989491301	12,21626894	13,37108537
35.780.086/0001-05	Vitreo Awp FI MM Investimento Exterior	17/02/2020	5,10119362	-18,80230517	-0,530046539	-1,524925557	17,56450726	14,88196626
34.447.464/0001-62	Gama Bridgewater Global Risk Premium Usd Fundo de Invest MM Invest No Exterior	29/01/2020	5,181390663	-17,75477839	-0,500516226	-1,502391486	17,25818306	14,93321654
30.338.659/0001-13	Chess ALpha FICFI MM	23/07/2018	-21,54141345	-17,46207854	-0,492264869	-0,521185188	42,98696922	32,4964652
29.574.952/0001-09	Versa Fit Long Biased FI MM	06/03/2018	-3,961906584	-14,56481589	-0,410589562	-0,757912296	38,94263994	37,9520065

Piores desempenhos em 24 meses

CNPJ	Fundo	Início	Retorno 2024	Retorno 24 Meses	%CDI 24 meses	Sharpe 24 meses	Volatilidade 12 meses	Perda máxima 12 meses
18.832.847/0001-06	Versa Long Biased FI MM	28/10/2013	-5,873532001	-46,05958431	-1,681351218	-0,906592411	47,43424515	45,31502563
30.338.659/0001-13	Chess ALpha FICFI MM	23/07/2018	-21,54141345	-34,05533819	-1,243150263	-0,729371064	42,98696922	32,4964652
29.574.952/0001-09	Versa Fit Long Biased FI MM	06/03/2018	-3,961906584	-24,79268737	-0,905028036	-0,912223433	38,94263994	37,9520065
23.960.625/0001-09	Safari 30 FICFI MM II	29/04/2016	-3,823080167	-20,27041983	-0,739947952	-1,266690696	23,90411111	24,35987981
38.001.966/0001-16	Mag Global Sustainable Fc de FI MM IE	14/10/2020	6,774057934	-18,71582158	-0,683199162	-1,287767865	17,72350585	17,71930029
11.301.137/0001-00	Seival Fgs Agressivo FICFI MM	07/12/2009	-7,76576556	-16,56846237	-0,604812328	-1,967503698	14,2829699	13,31654969
30.887.013/0001-95	Versa Tracker FI MM	27/08/2018	-10,81623698	-14,42075391	-0,526412744	-0,59548361	34,24222291	28,12812701
06.041.290/0001-06	Arx Extra FICFI MM	23/12/2003	-0,412189868	-13,84806886	-0,505507546	-1,927676545	14,80843993	10,48415307
29.259.742/0001-18	Itaú Long Bias MM FICFI	29/06/2018	2,485556269	-10,75786061	-0,392703111	-1,900869947	13,87290228	12,84408534
28.581.159/0001-66	Vinland Long Bias FICFI MM	29/03/2018	-6,154039001	-10,10885576	-0,369011948	-2,436514157	11,28655499	14,74929049

Piores desempenhos em 12 meses

CNPJ	Fundo	Início	Retorno 2024	Retorno 12 Meses	%CDI 12 meses	Sharpe 12 meses	Volatilidade 12 meses	Perda máxima 12 meses
45.126.981/0001-56	Skopos Inv Capablanca FI MM	14/02/2022	14,64901398	-34,41848468	-2,758696407	-1,31280339	35,92654157	44,77706587
28.653.850/0001-08	Spx Raptor F-22 FICFI MM Cp Ie	27/02/2018	1,902258758	-13,52555542	-1,084094825	-2,409980395	10,84908083	17,23291323
39.835.826/0001-06	BTGp Thunderbolt FI Em Cotas de FI MM Créd Priv IE Access	27/11/2020	1,897693655	-13,06390626	-1,047092909	-2,428312666	10,57592401	16,75577603
26.516.247/0001-59	Xpa Harpia FI Em Cotas de FI MM Créd Priv IE	25/05/2017	1,896508927	-12,83013363	-1,028355661	-2,41468387	10,53822154	16,55956076
30.068.713/0001-58	Xp Macro Plus FICFI MM	30/04/2018	-7,600826794	-12,56895895	-1,007422094	-2,165174154	11,63127234	14,39108087
24.454.718/0001-16	Jpmorgan Dolar Global Macro Op- portunities FI MM IE	17/05/2016	4,333788655	-9,776939403	-0,783637277	-1,560491953	14,33838964	16,67952904
11.301.137/0001-00	Seival Fgs Agressivo FICFI MM	07/12/2009	-7,76576556	-9,043042393	-0,724814262	-1,514855593	14,2829699	13,31654969
02.162.620/0001-52	Ventor Dólar Hedge FICFI MM	18/12/1997	1,674223374	-8,349962728	-0,669262822	-2,139211517	9,7883703	11,80090526
22.652.091/0001-82	Empírica Lótus Ipca FICFI MM Créd Priv	16/12/2015	1,129511671	-7,315530472	-0,586351428	-2,448746694	8,126095448	12,69655652
30.593.439/0001-36	Vinland Macro Plus FICFI MM	28/12/2018	-7,219286374	-4,447780025	-0,356496658	-2,678471818	6,352045566	8,431051891

DISCLAIMER

A INSIDE RESEARCH LTDA. (“INSIDE”), empresa do Grupo Levante Investimentos (“LEVANTE”), declara que participou da elaboração do presente relatório de análise e é responsável por sua distribuição exclusivamente nos canais autorizados das empresas do Grupo Levante, tendo como objetivo somente informar os seus clientes com linguagem clara e objetiva, diferenciando dados factuais de interpretações, projeções, estimativas e opiniões, não constituindo oferta de compra ou de venda de nenhum título ou valor mobiliário. Além disso, os dados factuais foram acompanhados da indicação de suas fontes e as projeções e estimativas foram acompanhadas das premissas relevantes e metodologia adotadas.

Todas as informações utilizadas neste documento foram redigidas com base em informações públicas, de fontes consideradas fidedignas. Embora tenham sido tomadas todas as medidas razoáveis para assegurar que as informações aqui contidas não são incertas ou equivocadas no momento de sua publicação, a INSIDE e os seus analistas não respondem pela veracidade das informações do conteúdo, mas sim as companhias de capital aberto que as divulgaram ao público em geral, especialmente perante a Comissão de Valores Mobiliários (“CVM”).

As informações, opiniões, estimativas e projeções contidas neste documento referem-se à data presente e estão sujeitas a mudanças, não implicando necessariamente na obrigação de qualquer comunicação no sentido de atualização ou revisão com respeito a tal mudança. Para maiores informações consulte a Resolução CVM nº 20/2021, e, também, o Código de Conduta da Apimec para o Analista de Valores Mobiliários. Em cumprimento ao artigo 16, II, da referida Resolução CVM nº 20/2021.

As decisões de investimentos e estratégias financeiras sempre devem ser realizadas pelo próprio cliente, de preferência, amparado por profissionais ou empresas habilitadas para essa finalidade, uma vez que a INSIDE não exerce esse tipo de atividade.

Esse relatório é destinado exclusivamente ao cliente da INSIDE que o contratou. A sua reprodução ou distribuição não autorizada, sob qualquer forma, no todo ou em parte, implicará em sanções cíveis e criminais cabíveis, incluindo a obrigação de reparação de todas as perdas e danos causados, nos termos da Lei nº 9.610/98, além da cobrança de multa não compensatória de 20 (vinte) vezes o valor mensal do serviço pago pelo cliente.

Em conformidade com os artigos 20 e 21 da Resolução CVM nº 20/2021, o analista Eduardo Jamil Rahal (inscrito no CNPI sob o nº 2947) declara que (i) é o responsável principal pelo conteúdo do presente relatório de análise; (ii) as recomendações nele contidas refletem única e exclusivamente as suas opiniões pessoais e que foram elaboradas de forma independente, inclusive com relação à INSIDE. Na contracapa deste relatório você encontra uma relação de todas as empresas que fazem parte do Grupo Levante. Para dirimir quaisquer dúvidas, entre em contato através dos canais de atendimento nos sites oficiais.

INSIDE

RESEARCH

www.insideresearch.com.br

LEVANTE

www.levanteideias.com.br

LVNT | corp
INSIDE

www.lvntcorp.com.br

LEVANTE | Asset
Management

www.levanteasset.com.br