

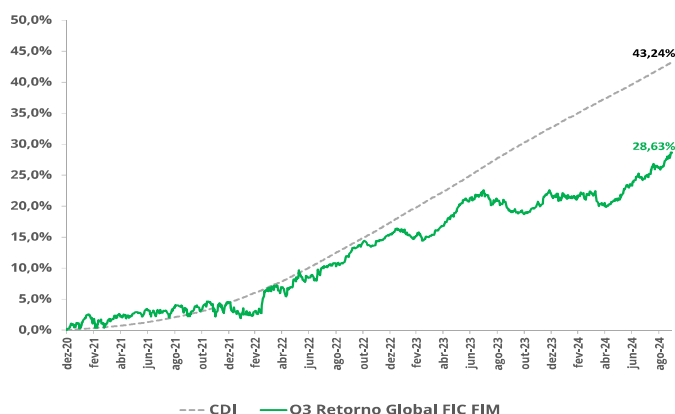
Objetivo do fundo

O fundo tem como objetivo obter ganhos de capital mediante operações nos mercados de juros, câmbio, ações, commodities, dívida, além de exposição ainda que indireta em ativos digitais, utilizando-se dos instrumentos tanto nos mercados à vista quanto nos de derivativos. Poderá utilizar, entre outros, de mecanismos de hedge, operações de arbitragem e alavancagem. A exposição dependerá, entre outros fatores, da liquidez e volatilidade dos mercados em que estiver atuando.

Rentabilidade mensal

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	* em 29/12/2020 Desde o início*
2024	O3 RET G	-0,58%	-0,11%	0,81%	-1,53%	0,62%	1,71%	1,20%	1,13%	1,89%				5,21%	28,63%
	% CDI	-	-	97%	-	75%	217%	133%	130%	227%				65%	66%
	CDI +	-1,55%	-0,92%	-0,03%	-2,42%	-0,21%	0,92%	0,30%	0,26%	1,06%				-2,78%	-14,61%
2023	O3 RET G	0,53%	-0,77%	0,05%	1,34%	2,09%	1,77%	1,06%	-1,38%	-1,35%	-0,44%	1,54%	1,43%	5,93%	22,26%
	% CDI	47%	-	4%	146%	186%	165%	99%	-	-	-	167%	159%	45%	68%
	CDI +	-0,59%	-1,69%	-1,12%	0,42%	0,97%	0,70%	-0,01%	-2,52%	2,32%	-1,43%	0,62%	0,53%	-7,12%	-10,38%
2022	O3 RET G	-1,56%	0,14%	3,24%	0,67%	0,94%	0,44%	1,47%	0,22%	1,85%	1,69%	0,15%	0,90%	10,56%	15,41%
	% CDI	-	19%	351%	80%	91%	44%	142%	19%	172%	166%	15%	80%	85%	89%
	CDI +	-2,29%	-0,61%	2,32%	-0,17%	-0,09%	-0,57%	0,43%	-0,95%	0,77%	0,67%	-0,87%	-0,22%	-1,81%	-1,91%
2021	O3 RET G	0,11%	0,75%	0,10%	0,98%	0,54%	0,50%	-0,38%	0,75%	-1,32%	0,99%	-0,40%	1,54%	4,19%	4,39%
	% CDI	72%	556%	51%	472%	203%	163%	-	176%	-	206%	-	201%	95%	100%
	CDI +	-0,04%	0,61%	-0,10%	0,77%	0,28%	0,19%	-0,74%	0,32%	-1,76%	0,51%	-0,99%	0,77%	-0,20%	-0,02%

Rentabilidade Fundo X CDI



Atribuição de Performance

	Mês	Ano	12M
Ações	1,14%	3,12%	3,31%
Commodities	0,01%	0,31%	0,15%
Moedas	0,02%	-0,73%	-0,62%
Renda Fixa	0,42%	-1,05%	-0,45%
Quantitativo	0,00%	0,00%	0,01%
Caixa	0,46%	5,03%	7,51%
Custos	-0,16%	-1,46%	-2,02%
O3 Retorno Global	1,89%	5,21%	7,88%

Patrimônio em 30/09/2024

PL Atual	R\$ 141.849.592,85
PL Médio (12 meses)	R\$ 148.487.342,20

Estatísticas

Descrição	2024	* em 29/12/2020 Início*
Volatilidade anualizada	3,82%	4,11%
Melhor mês	1,89%	3,24%
Pior mês	-1,53%	-1,56%

Informações complementares

Gestor: O3 Gestão de Recursos LTDA
Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros S/A DTVM
Custodiante: Banco BTG Pactual S.A
Auditor: Ernst & Young
Risco: Lote 45
Categoria ANBIMA: Multimercado Macro
Tributação: Longo prazo

Público: Investidor em Geral
Investimento inicial mínimo: R\$ 1.000
Movimentação mínima: R\$ 500
Aplicação: até às 14h30. **Cotização:** D+1
Resgate: até às 14h30. **Cotização:** D+30.
Pagamento: D+1
Taxa de Adm.: 1,95%a.a.
Taxa de Perf.: 20% sobre o que exceder CDI

Acompanhe nossas redes sociais:

Avenida Brigadeiro Faria Lima, 2.277, 22º andar, Jd. Paulistano – CEP: 01452-000, São Paulo - SP | E-mail: contato@o3capital.com.br | www.o3capital.com.br | [Youtube: O3 Capital](https://www.youtube.com/O3Capital)



AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESTE MATERIAL TÊM O CARÁTER MERAMENTE INFORMATIVO E NÃO DEVEM SER CONSIDERADAS COMO OFERTA DE VENDA, NEM TAMPOUCO UMA RECOMENDAÇÃO DE INVESTIMENTOS DOS REFERIDOS FUNDOS DE INVESTIMENTO. É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA DO PROPECTO E REGULAMENTO DO FUNDO DE INVESTIMENTO PELO INVESTIDOR AO APLICAR SEUS RECURSOS. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTE FUNDO DE INVESTIMENTO NÃO IMPLICA, POR PARTE DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS OU DA ANBIMA, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS. OS INVESTIMENTOS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO DE QUE TRATAM ESTE PROSPECTO APRESENTAM RISCOS PARA O INVESTIDOR. AINDA QUE O GESTOR DA CARTEIRA MANTENHA SISTEMA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS, NÃO HÁ GARANTIA DE COMPLETA ELIMINAÇÃO DA POSSIBILIDADE DE PERDAS PARA O FUNDO DE INVESTIMENTO E PARA O INVESTIDOR, QUE NÃO CONTA COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, DO GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. OS FUNDOS DE INVESTIMENTO PODEM UTILIZAR ESTRATÉGIAS COM DERIVATIVOS COMO PARTE INTEGRANTE DE SUA POLÍTICA DE INVESTIMENTO, AS QUAIS PODEM RESULTAR EM PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS. A RENTABILIDADE INFORMADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS.

Comentário do gestor

Destaques do mês:

Em setembro, ganhos ficaram concentrados em posições compradas na bolsa norte-americana e ações de tecnologia na China. Em renda fixa, estratégias visando a queda de juro nos EUA e México contribuíram positivamente, assim como as posições compradas em inclinação nos EUA e na China. Em crédito, posição comprada no índice High Yield norte-americano contribuiu positivamente. Em moedas, destaque negativo veio de posições vendidas no Yuan chinês e positivo veio da estratégia comprada no Peso mexicano. Nas commodities, posições compradas em cobre contribuíram positivamente.

Posicionamento atual:

Em renda fixa, seguimos comprados em inclinação de curva nos EUA e na China, além de posições esperando queda de juros nos EUA e no México. Em renda variável, seguimos com uma postura tática em relação às bolsas. Em relação às moedas, saímos de posições vendidas no Yuan chinês e continuamos com a estratégia comprada no peso mexicano. Adicionamos posições vendidas no Peso chileno e compradas no Yen japonês. Nas commodities, seguimos com posições compradas em cobre.

Risco

