

Sumário

O NEO MULTI ESTRATÉGIA 30 é um fundo baseado principalmente em operações de valor relativo através das estratégias de juros, moedas e ações nos mercados locais e internacionais tanto no mercado à vista quanto nos seus derivativos. As operações direcionais deverão ter papel secundário no resultado do fundo, priorizando operações que não estejam relacionadas a movimentos específicos de mercado, trazendo uma diversificação eficiente da carteira.

Rentabilidade (%)	Desde Início	48 meses	36 meses	24 meses	12 meses	Acum. 2021	Fevereiro 2022
NEO Multi 30	327,62	29,19	21,66	12,75	3,74	3,31	1,38
% CDI	133	136	153	156	66	222	185
Volatilidade	4,8	6,1	6,5	7,6	5,8	4,6	3,8
P.L. Médio (R\$ MM)	393,7	498,6	435,6	363,7	426,6	435,4	436,5

Retorno (%)

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	CDI	Acum. Fundo	Acum. CDI
2022	1,90	1,38											3,31	1,49	327,62	246,00
2021	0,58	0,36	1,76	0,54	-0,67	2,49	-0,45	-0,81	0,76	-4,37	0,78	0,54	1,37	4,40	313,93	240,93
2020	0,61	1,04	2,01	2,12	0,17	0,47	-0,11	1,74	-0,33	-0,88	1,16	1,13	9,46	2,77	308,35	226,57
2019	1,53	-0,04	-0,79	0,67	0,75	-0,23	1,16	0,97	1,20	-0,04	0,47	1,84	7,73	5,97	273,07	217,77
2018	0,82	0,37	1,04	0,31	0,00	1,75	1,65	0,18	0,86	0,52	-0,35	-1,38	5,87	6,42	246,31	199,88
2017	-0,17	-0,35	0,60	1,97	2,34	0,68	1,14	1,48	0,95	0,39	1,03	0,04	10,55	9,95	227,10	181,78
2016	3,55	1,70	0,19	2,40	0,56	0,38	0,97	1,49	1,33	-0,50	1,46	1,25	15,76	14,00	195,88	156,28
2015	1,70	1,22	2,91	1,40	1,18	0,78	1,81	0,95	0,96	3,10	1,17	2,71	21,78	13,23	155,61	124,80
2014	1,37	0,97	0,31	0,64	0,22	0,66	0,79	-0,68	1,65	0,17	1,24	2,98	10,78	10,81	109,89	98,54
2013	1,31	-0,05	0,79	0,71	0,38	-1,23	0,62	-0,40	0,70	0,39	0,33	0,93	4,54	8,05	89,46	79,17
2012	0,25	0,83	1,00	0,42	1,25	0,36	0,33	1,29	-0,26	0,69	0,85	0,20	7,44	8,41	81,23	65,82
2011	0,35	1,14	0,11	0,85	0,59	1,06	1,22	2,43	2,50	0,70	1,73	0,45	13,91	11,59	68,68	52,95
2010	0,93	0,90	0,18	1,05	0,64	0,92	-0,20	1,30	0,92	0,53	1,00	1,45	10,06	9,74	48,08	37,06
2009	1,38	1,92	1,68	0,96	1,23	0,89	1,44	1,28	0,87	0,91	1,63	0,87	16,14	9,90	34,55	24,89
2008	0,91	1,27	0,29	0,60	-0,78	1,29	-0,54	1,37	1,72	1,36	3,41	2,56	14,25	12,37	15,85	13,65
2007											0,73	0,66	1,40	1,14	1,40	1,14

Desempenho, Risco e Visão Geral do Fundo

Expected Shortfall 21 dias	3,1%
Volatilidade estimada	4,5%
Cota do Fundo	4,276177
Número de Meses Positivos	145
Número de Meses Negativos	25
Número de Meses Acima do CDI	103
Número de Meses Abaixo do CDI	69
Maior Rentabilidade Mensal	3,6%
Menor Rentabilidade Mensal	-4,4%
Patrimônio Líquido (R\$)	439.790.277
Patrimônio Médio em 12 meses (R\$)	426.566.592

Dados para Movimentações

Aplicação mínima	R\$ 25.000,00 (PCO: R\$ 1.000,00)
Taxa de administração	2,0% a.a.
Taxa de performance	20% sobre o que exceder 100% do CDI
Carência Inicial	Não possui
Cota de aplicação	D+1
Cota de resgate	D+30
C.N.P.J	08.771.538/0001-01

Informações Gerais

Data de início do Fundo	21.nov.2007
Classificação Anbima	Multimercado - Estratégia - Macro
Gestor do Fundo	Neo Multimercado
Administrador	Intrag DTVM S.A.
Custódia	Banco Itaú
Público Alvo	Investidores em Geral
Código ANBIMA	198.889

Desempenho NEO Multi Estratégia 30 FIC FIM x CDI

