

Itaú Long And Short 30 MM FICFI



31 de Outubro de 2024

Objetivos do Fundo

Estratégia de ações Long and Short que utiliza posições compradas, em ações com potencial de valorização, e vendas, em ações com potencial de desvalorização, buscando retorno em distorções de preços independente da direção do mercado.

8,07%

Rentabilidade nominal no ano

11,50%

Rentabilidade nominal dos últimos 12 meses

113,75%

Rentabilidade nominal dos últimos 10 anos

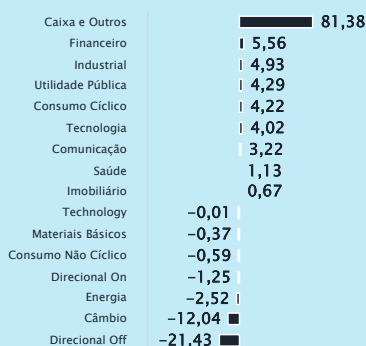
Análise de Retorno

Termômetro de Risco



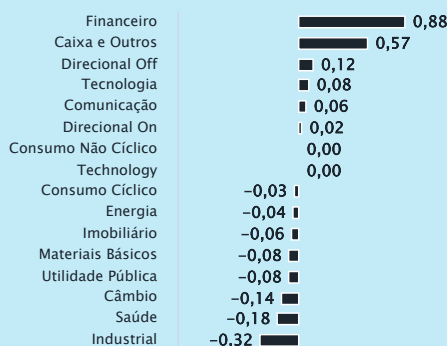
Alocação média setorial no mês

% da carteira

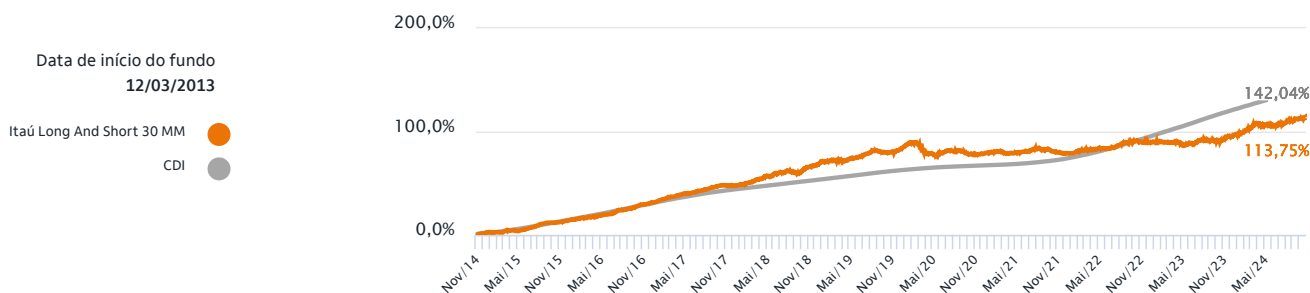


Contribuição Setorial no Mês

Retorno em %



Retorno Acumulado

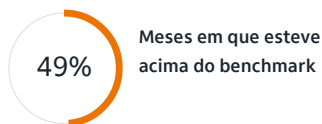


Retorno Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
Fundo	0,69%	1,86%	2,69%	-1,36%	-0,15%	0,36%	1,39%	0,87%	0,70%	0,80%	-	-	8,07%
2024													
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	0,93%	-	-	8,99%
%CDI	71,85%	232,49%	322,30%	-153,79%	-18,48%	45,64%	153,61%	100,20%	83,97%	86,13%	-	-	89,79%
Fundo	0,15%	-0,56%	-0,14%	-0,09%	-0,59%	0,60%	1,52%	-0,61%	0,41%	0,15%	1,90%	1,24%	4,00%
2023													
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%
%CDI	13,12%	-61,41%	-11,59%	-9,80%	-52,85%	55,51%	142,10%	-53,81%	41,59%	14,80%	207,54%	138,71%	30,68%
Fundo	1,13%	0,53%	0,46%	0,55%	-0,01%	0,70%	0,97%	1,37%	0,32%	0,15%	0,39%	-0,40%	6,31%
2022													
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,37%
%CDI	154,50%	71,14%	50,14%	66,29%	-1,43%	69,54%	93,55%	116,97%	29,43%	14,30%	37,91%	-36,03%	51,00%

Comentários do Gestor

140 Meses desde o início do fundo



3,33% Volatilidade 12 meses

A estratégia apresentou retorno inferior ao benchmark no mês de outubro. Entre as contribuições positivas, por setor, destaque para as posições em financeiro, tecnologia e serviço de comunicação. Do lado dos maiores detratores, os mais relevantes foram as posições nos setores industrial, saúde e utilidade pública.

Características

Volume Global Mínimo* R\$ 10.000,00	Taxa de Administração cobrada 1,50% ao ano	Horário para Movimentação Até às 16:00
Classificação Tributária Longo Prazo Sem Compromisso	Taxa de Performance 20,0% sobre o que exceder 100% do CDI	Aplicação e Resgate Cota de aplicação: D+0
Patrimônio Líquido Médio Últimos 12 meses R\$ 8.995.594,43	Público Alvo Público Em Geral	Cota de Resgate (dias úteis): D+21 Crédito do Resgate (dias úteis após cotização): D+1

O fundo poderá, eventualmente, apresentar indisponibilidade, permanente ou temporária, de acesso por parte de investidores. Em caso de dúvidas, consulte seu gerente de relacionamento

Acesse outros documentos relevantes deste fundo: www.itaú.com.br/investimentos-previdencia/fundos/informacoes-cotistas/

Glossário: LF - Letra Financeira. CDB - Certificado de Depósito Bancário. LSF - Letra Financeira Subordinada. LFSN - Letra Financeira Elegível - Nível II. DEB - Debentures. NP - Notas Promissórias. CCB - Cédula de Crédito Bancário. FIDC - Fundo de Investimento em Direitos Creditórios. DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial. Debentures Conversível. Certificado de Recebíveis Imobiliários. LC - Letra de Câmbio. LCA - Letra de Crédito Agrícola. LCI - Letra de Crédito Imobiliário. DEB COMP - Debênture Compromissada. CDB Vinc - Certificado de Depósito Interbancário Vinculado. CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliário. CDCA - Certificado de Direitos Creditórios do Agronegócio. CPR - Contas a Pagar e Receber. DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial. COMPR - Operação Compromissada. LH - Letra Hipotecária. TERMO - Contrato a Termo



Signatory of:



Informações relevantes

ITAÚ LONG AND SHORT 30 MULTIMERCADO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ 17.412.175/0001-09 - 31/10/2024

Este fundo é supervisionado e fiscalizado pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM (Serviço de atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br). Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Os rendimentos serão tributados semestralmente, no último dia útil dos meses de maio e novembro, à alíquota de 15%. No momento do resgate, será aplicada a alíquota complementar em função do prazo da aplicação: até 180 dias, 22,5%; de 181 a 360 dias, 20%; de 361 a 720 dias, 17,5%; acima de 720 dias, 15%. Haverá cobrança de IOF regressivo no caso de resgates de aplicações com menos de 30 dias. Público alvo: O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de pessoas físicas e/ou jurídicas, bem como de fundos de investimento ou fundos de investimento em cotas de fundos de investimento em geral, todos clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de empresas a eles ligadas. Objetivo do fundo: Superar o CDI no longo prazo por meio da aplicação em outros fundos de investimento. Tipo Anbima: MULTIMERCADOS LONG AND SHORT - DIRECIONAL - Fundos que são baseados nas estratégias preponderantes adotadas e suportadas pelo processo de investimento adotado pelo gestor como forma de atingir os objetivos e executar a política de investimentos dos Fundos. Fundos que têm como objetivo realizar operações de ativos e derivativos ligados ao mercado de renda variável, montando posições compradas e vendidas. O resultado deve ser proveniente, preponderantemente, da diferença entre essas posições. Os recursos remanescentes em caixa devem estar investidos em cotas de Fundos Renda Fixa - Duração Baixa - Grau de Investimento - Soberano ou em ativos permitidos a estes desde que preservadas as regras que determinam a composição da carteira do tipo ANBIMA. Início do fundo em: 12/03/2013. Taxa de Administração máx.: 1,50%. Taxa de Performance: 20% do que exceder 100% do CDI. Fonte de dados do material: Itaú Asset Management. Material de divulgação do fundo - A Itaú Asset Management é a gestora de fundos de investimentos do Itaú Unibanco. Leia a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. 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. Dúvidas, sugestões e reclamações, fale com o seu Private Banker. Se necessário, utilize o SAC Itaú 0800 728 0728, todos os dias, 24h, ou o Fale Conosco Itaú Private Bank (www.itauprivatebank.com.br). Se desejar a reavaliação da solução apresentada após utilizar esses canais, recorra à Ouvidoria Corporativa Itaú 0800 570 0011, dias úteis, das 9 às 18h, Caixa Postal nº 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, 24h por dia, 7 dias por semana, 0800 722 1722.