

## ESTRATÉGIA

Através de modelos quantitativos, com base em fatores fundamentalistas e técnicos, selecionamos carteiras altamente diversificadas, rebalanceadas periodicamente. A mecânica usada para aplicação desses fatores busca identificar ineficiências persistentes mas inconstantes do mercado, pouco lembradas por grande parte da indústria. Fazendo isso consistentemente, buscamos atingir o objetivo do fundo, de superar consistentemente o Ibovespa, no longo prazo.

## RENTABILIDADES DA CARTEIRA

|             | Jan           | Fev           | Mar            | Abr           | Mai           | Jun          | Jul           | Ago           | Set           | Out           | Nov           | Dez           | Ano            |
|-------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| <b>2018</b> |               |               |                |               |               |              |               |               |               |               |               | <b>-0,76%</b> | <b>-0,76%</b>  |
| Ibovespa    |               |               |                |               |               |              |               |               |               |               |               | <b>-0,06%</b> | <b>-0,06%</b>  |
| <b>2019</b> | <b>10,77%</b> | <b>-0,42%</b> | <b>-4,39%</b>  | <b>-3,38%</b> | <b>1,29%</b>  | <b>2,02%</b> | <b>3,36%</b>  | <b>0,40%</b>  | <b>1,76%</b>  | <b>0,98%</b>  | <b>2,85%</b>  | <b>15,10%</b> | <b>31,92%</b>  |
| Ibovespa    | <b>10,82%</b> | <b>-1,86%</b> | <b>-0,18%</b>  | <b>0,98%</b>  | <b>0,70%</b>  | <b>4,06%</b> | <b>0,84%</b>  | <b>-0,67%</b> | <b>3,57%</b>  | <b>2,36%</b>  | <b>0,95%</b>  | <b>6,85%</b>  | <b>31,66%</b>  |
| <b>2020</b> | <b>1,99%</b>  | <b>-3,26%</b> | <b>-33,30%</b> | <b>4,11%</b>  | <b>-2,98%</b> | <b>5,70%</b> | <b>4,92%</b>  | <b>-0,52%</b> | <b>-2,61%</b> | <b>1,77%</b>  | <b>13,88%</b> | <b>6,65%</b>  | <b>-11,72%</b> |
| Ibovespa    | <b>-1,63%</b> | <b>-8,43%</b> | <b>-29,90%</b> | <b>10,25%</b> | <b>8,57%</b>  | <b>8,76%</b> | <b>8,27%</b>  | <b>-3,44%</b> | <b>-4,80%</b> | <b>-0,69%</b> | <b>15,90%</b> | <b>9,29%</b>  | <b>2,91%</b>   |
| <b>2021</b> | <b>-2,13%</b> | <b>-2,57%</b> | <b>7,60%</b>   | <b>8,19%</b>  | <b>6,04%</b>  | <b>0,92%</b> | <b>-4,41%</b> | <b>-2,17%</b> | <b>-2,13%</b> |               |               |               | <b>8,73%</b>   |
| Ibovespa    | <b>-3,32%</b> | <b>-4,37%</b> | <b>5,99%</b>   | <b>1,94%</b>  | <b>6,16%</b>  | <b>0,46%</b> | <b>-3,94%</b> | <b>-2,48%</b> | <b>-6,57%</b> |               |               |               | <b>-6,75%</b>  |

## OBJETIVO

O Fundo tem como objetivo superar consistentemente o Ibovespa em janelas longas.

## UM POUCO MAIS SOBRE MODELAGEM QUANTITATIVA

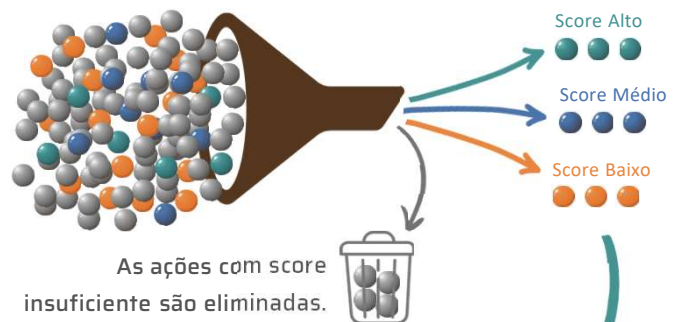
Nossa estratégia seleciona ativos com base em fatores fundamentalistas e técnicos. A mecânica usada para aplicação desses fatores busca identificar ineficiências do mercado.

## INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

|                                       |                           |
|---------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publico Alvo</b>                   | Investidores em geral     |
| <b>Tributação</b>                     | 15% s/ o ganho nominal    |
| <b>Classificação Anbima</b>           | Ações Livre               |
| <b>Data de Início</b>                 | 13/12/2018                |
| <b>Gestor</b>                         | Astro Asset               |
| <b>Administrador e Custodiante</b>    | Banco Genial S.A.         |
| <b>Auditor</b>                        | KPMG                      |
| <b>Aplicação</b>                      | D+1                       |
| <b>Resgate (Cotização)</b>            | D+10 (sem taxa de saída)  |
| <b>Resgate Antecipado (Cotização)</b> | D+1 (taxa de saída de 5%) |
| <b>Resgate (Liquidação)</b>           | D+2 do dia de cotização   |
| <b>Aplicação Mínima</b>               | R\$ 100                   |
| <b>Movimentação Mínima</b>            | R\$ 100                   |
| <b>Taxa de Administração</b>          | 2% a.a.                   |
| <b>Taxa de Performance</b>            | 20% do que exceder o IBOV |
| <b>PL Set/21</b>                      | R\$ 6.026.952,16          |

Universo de Ações

Elegíveis na B<sup>3</sup>



Seleção e Ponderação no Astro Smart FIA

As ações com score positivo são incluídas na carteira do fundo e ponderadas pelo seu score.

