

OBJETIVO DO FUNDO

Objetivo de proporcionar ganhos de capital superiores ao rendimento do CDI em períodos de 01 (um) ano.

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

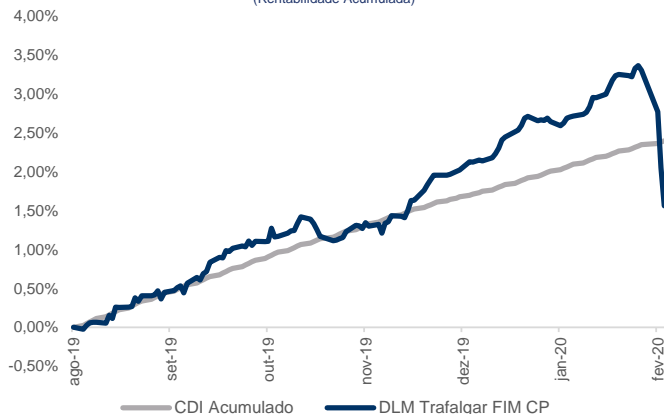
A política de investimento do fundo consiste em alocações em títulos públicos e privados, tanto no Brasil quanto no exterior. O fundo realiza hedge cambial para a parcela dos investimentos no exterior (limitados a 40% do PL do fundo), mitigando o risco cambial e atrelando sua remuneração a um percentual do CDI.

PÚBLICO ALVO

O fundo tem como público alvo investidores qualificados, tais como pessoas físicas, jurídicas, fundos de investimento e fundos de investimento em cotas de fundos de investimento que buscam obter retornos financeiros de suas aplicações e para tanto estejam dispostos a aceitar os riscos decorrentes do mercado financeiro.

COMPARATIVO DE PERFORMANCE

(Rentabilidade Acumulada)



RENTABILIDADE MENSAL 2020

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM. ¹
2020	Fundo	0,58%	-1,13%											-0,55%	1,56%
	CDI	0,38%	0,29%											0,67%	2,40%
	%CDI	154,11%	-381,91%											-82,03%	65,16%

RENTABILIDADE MENSAL DESDE O INÍCIO (Início em 30/08/2019)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM. ¹
2019	Fundo									0,47%	0,69%	0,14%	0,82%	2,13%	2,13%
	%CDI									101,34%	142,59%	36,08%	216,59%	124,01%	124,01%

RENTABILIDADE

	Fundo	% CDI
Acumulada desde o início	1,56%	65,16%
Últimos 12 meses	-	-
Últimos 24 meses	-	-
Últimos 36 meses	-	-

ANÁLISE ESTATÍSTICA

Patrimônio Atual	R\$ 119.550.571,73
Patrimônio Médio*	R\$ 86.911.310,53
Nº de meses acima do CDI	4
Nº de meses abaixo do CDI	2
Nº de meses positivos	5
Nº de meses negativos	1
Maior retorno mensal	0,82%
Menor retorno mensal	-1,13%

* Desde o início

MEDIDAS DE RISCO*

Var	0,81%
Volatilidade	1,70%
Índice de Sharpe	-0,96

* Desde o início

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA ATUAL

CDB	0%
Letras Financeiras	5%
Debêntures	39%
Operações Estruturadas	0%
FIDC	3%
Investimento no exterior	36%
Caixa	17%

DISTRIBUIÇÃO POR RATING⁴

BBB	0%
A	9%
AA	66%
AAA	25%

DISTRIBUIÇÃO POR SETOR⁴

Bens de Capital	0,00%
Concessões	4,06%
Consumo cíclico	1,04%
Consumo não cíclico	5,90%
Educação	1,23%
Energia	9,89%
FIDC	2,91%
Imobiliário	4,30%
Locação de Veículos	5,44%
Papel / Celulose	0,80%
Petroquímico	1,01%
Portuário	0,42%
Setor Financeiro	6,22%
Saneamento	2,51%
Saúde	0,84%
Siderurgia	0,52%
Telecom	0,00%
TOTAL EM CRÉDITO PRIVADO	47,09%

CARACTERÍSTICAS

Fundo: DLM Trafalgar Fundo de Investimento Multimercado Crédito Privado

Gestão: DLM Invista Gestão de Recursos LTDA

Cogestão: Trafalgar Gestão de Recursos LTDA

Administração: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S/A

Custódia: BNY Mellon Banco S.A.

Classificação Anbima: Multimercados Livre

Código Anbima: 505161

Bloomberg: DLMTRAM <BZ> <Equity>

Taxa de Administração: 1.00% a.a.²

Taxa de Performance: 15% sobre o excedente do CDI

Benchmark: CDI

Mínimo de Aplicação Inicial: R\$ 20.000,00³

Mínimo de Movimentação: R\$ 1.000,00

Saldo Mínimo de Permanência: R\$ 20.000,00³

Cota de Aplicação: D+0 (cota do dia, desde a disponibilidade dos recursos)

Cota de Resgate: D+59 (cinquenta e nove dias corridos após a solicitação de resgate)

Liquidação do Resgate: D+1 (um dia útil após a data de cotização)

IR: 15% a 22,5%, de acordo com o tempo de permanência

IOF: Regressivo para investimento inferior a 30 dias

Horário Limite para Movimentações: 14h

Dados Bancários

Favorecido: DLM Trafalgar FIM CP **CNPJ:** 33.784.218/0001-33 **Banco:** 017 – BNY Mellon Banco S.A. **Agência:** 001 **C/C:** 3613-7

Signatory of:



¹Rentabilidade acumulada desde o início do FUNDO. ²A taxa de administração prevista é a taxa de administração mínima do FUNDO. Tendo em vista que o FUNDO admite a aplicação em cotas de fundos de investimento, fica instituída a taxa de administração máxima de 1.10% a.a. sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO. ³Limites de movimentação exclusivamente para cotistas conta e ordem: Mínimo de Aplicação Inicial e Saldo Mínimo de Permanência R\$ 5.000,00. ⁴ Informação referente aos ativos da carteira de crédito local.

Pretende-se com este relatório de desempenho apenas divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela DLM Invista Gestão de Recursos LTDA, não significando oferta de venda do DLM Trafalgar FIM CP. Leia o formulário de informações complementares, lâmina de informações essenciais e o regulamento antes de investir. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os indicadores econômicos são meras referências econômicas, e não metas ou parâmetros de performance. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito – FGC. Este fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. O fundo pode estar exposto à significativa concentração em ativos financeiros de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo 12 (doze) meses.

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. (CNPJ: 02.201.501/0001-61). Av. Presidente Wilson, 231, 11º andar, Rio de Janeiro, RJ, CEP: 20.030-905. Telefone: (21) 3219-2500 / Fax (21) 3219-2501 / www.bnymellon.com.br/sf - SAC: sac@bnymellon.com.br ou (21) 3219-2600. (11) 3050-8010 / Ouvidoria: ouvidoria@bnymellon.com.br ou 0800 725 3219. Todos os documentos, como Regulamento, o Formulário de Informações Complementares e a Lâmina de Informações Essenciais podem ser encontrados em www.dlminvesta.com.br. Supervisão e fiscalização - Comissão de Valores Mobiliários (CVM) / Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.