

Características Principais

Data de Início
26/02/2021

Objetivo do Fundo

Buscar rentabilidade acima do CDI através de estratégias de investimento baseado em cenários macroeconômicos no médio e longo prazo, tem como objetivo proporcionar aos cotistas a valorização de suas cotas por meio da aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo, sem o compromisso de concentração em nenhum fator em especial, observadas as disposições da política de investimento.

Público Alvo

Investidores em geral, pessoas físicas e jurídicas e/ou fundos de investimentos ou fundos de investimentos em cotas de fundos de investimentos.

Política de Investimento

Investir no mínimo 95% de seus recursos no GRIMPER BLANC MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO inscrito no CNPJ/ME sob o nº 37.498.601/0001-86, ("Fundo Master").

Benchmark

CDI

Classificação ANBIMA

Multimercado - Macro

Gestor

Grimper Capital Gestora de Recurso LTDA

Custodiante

Santander Caceis Brasil DTVM S.A.

Auditor

PwC

Movimentações

Aplicação Mínima Inicial: R\$ 1.000,00

Movimentação Mínima: R\$ 1.000,00

Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00

Resgates

Cotização d+30 e pagamento no primeiro dia útil subsequente

Taxa de Administração

1,9% a.a., paga mensalmente*

Taxa de Performance

20% sobre o que exceder 100% do CDI, paga semestralmente

Taxa de Saída

Não haverá cobrança

Tributação

IR: O IR na fonte incidirá no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano (modalidade "come cotas"), ou no resgate, se ocorrido em data anterior, observando se, adicionalmente, o seguinte: enquanto o FUNDO mantiver uma carteira de longo prazo, como tal entendendo se uma carteira de títulos com prazo médio superior a 365 dias, o IR será cobrado às alíquotas de: 22,5% prazo de até 180 dias; 20,0% prazo de 181 até 360 dias; 17,5% em aplicações com prazo de 361 até 720 dias; 15,0% em aplicações com prazo acima de 720 dias.

IOF: As aplicações com prazos inferiores a 30 dias são sujeitas à cobrança do Imposto sobre Operações Financeiras (IOF).

*Considerando eventuais investimentos em outros fundos, a taxa de administração poderá atingir no máximo 2,50% ao ano sobre o PL do fundo

Comentário do Gestor

No mês de fevereiro tivemos ganhos nas posições de valor relativo em ações locais, em posições tomadas em juros internacionais longos, comprados em USD e net short em bolsa Brasil. Perdas vieram de posições compradas em bolsa internacional, posições compradas em commodities e aplicadas em juros internacionais curtos.

Com relação ao posicionamento da carteira, estamos tomados em juros nos EUA, Europa, Austrália e Japão tanto na parte curta quanto longa da curva em 2.5 PL equivalente ano. Seguimos comprados em bolsa internacional, particularmente nos EUA, e net vendidos em bolsa Brasil. Seguimos comprados em USD vs uma cesta de moedas. E finalmente, estamos comprados em inclinação no pré no Brasil.

Rentabilidade (%)

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2021	Fundo	-	-	0,47	1,08	0,92	0,37	-0,07	0,14	-0,15	0,46	-1,77	0,53	1,98	1,98
	% CDI	-	-	238	521	346	122	-	34	-	96	-	70	48	48
2022	Fundo	-0,99	0,37	1,07	2,29	0,18	-2,31	-0,73	2,22	2,73	0,69	1,20	0,57	7,41	9,54
	% CDI	-	50	116	274	17	-	-	190	255	68	118	51	60	56
2023	Fundo	0,44	-0,91	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,47	9,02
	% CDI	39	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	47

Data de Início: 26/02/2021

Rentabilidade Acumulada x CDI



Indicadores

	Fundo
Valor da Cota ¹	1,09020638
PL Atual ¹	R\$ 248.498.771
PL Médio em 12 (doze) meses	R\$ 166.975.081
PL do Fundo Master ¹	R\$ 591.664.418
PL Total Sob Gestão da Grimper Capital ¹	R\$ 758.789.780
Retorno Máximo Mensal ³	2,73%
Retorno Mínimo Mensal ³	-2,31%
Nº Meses Positivos ³	17
Nº Meses Negativos ³	7
Índice de Sharpe ³	N/A
Volatilidade Anualizada ³	3,65%

¹Valores em milhares no fechamento de 28/2/2023

²Valor do patrimônio líquido médio mensal do fundo apurado no último dia útil de cada mês, nos últimos 12 (doze) meses ou desde o início.

³Desde o início do fundo 26/02/2021

Fonte: GrimperCapital

Grimper Capital Gestora de Recursos LTDA

Rua Iguatemi, 448, 14º Andar, Cj: 1401

São Paulo – SP, CEP: 01451-010

Telefone: (11) 4632-4500

www.grimpercapital.com.br

contato@grimpercapital.com.br

Serviço de Atendimento CVM ao Cidadão: www.cvm.org.br

