

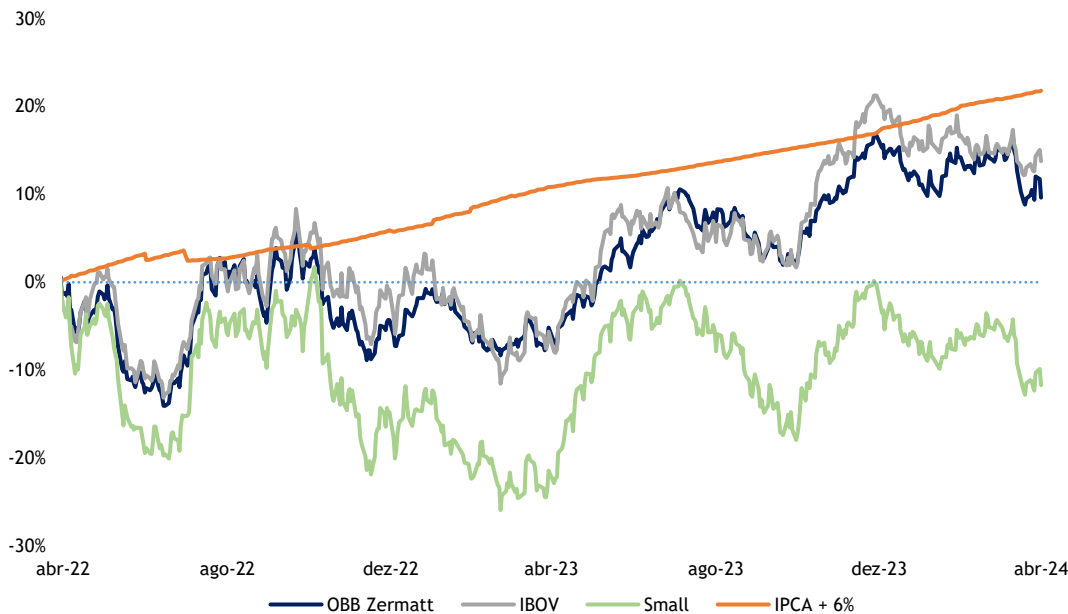
OBB Zermatt Equity Total Return FIM

Lâmina de performance - Mensal

abril/2024

*Dados calculados até a data de criação da lâmina: 02/05/2024

Rentabilidade Acumulada vs. Benchmarks



INFORMAÇÕES DO FUNDO

Nome do fundo: OBB Zermatt Equity Total Return FIM	
Data de Início: 25/04/2022	
CNPJ: 44.643.273/0001-20	
Tributação: Renda Variável	
Público Alvo: Qualificado	
Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.	
Custodiante: BNY Mellon Banco S.A.	
Gestor: OBB Capital Asset Management	
P.L.	R\$6.592.764,31
P.L. 12 M	R\$4.873.948,90

2024	MTD	YTD	6m	12m	SI
OBB Zermatt (%)	-5,0%	-6,1%	6,7%	15,6%	9,6%
IBOV (%)	-1,7%	-6,2%	11,3%	20,6%	13,8%
Small Caps (%)	-7,8%	-11,5%	6,5%	12,4%	-11,7%
IPCA+6 (%)	0,8%	3,8%	5,5%	9,8%	21,7%

INFORMAÇÕES DE COTA

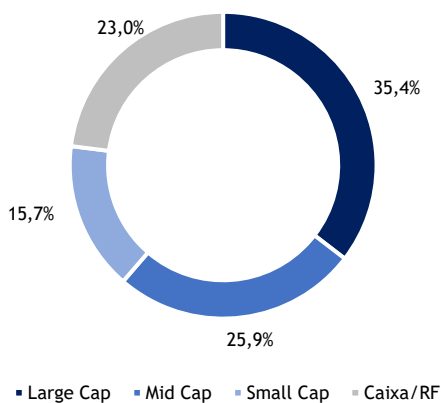
Aplicação Mínima	R\$1.000
Mov. Mínima	R\$500
Taxa de Adm.	2% a.a.
Benchmark	IPCA + 6%
Performance	20%
Cotização	D+28
Liquidação	D+30
Última Cota	1,09621900
Código Anbima	647391

A volatilidade do mercado pode impactar no retorno da cota. A performance do investidor pode ser mais alta ou baixa que a performance apresentada na tabela acima, dependendo da data do investimento no fundo. Performance passada não é uma garantia, ou necessariamente, uma indicação, de resultado futuro. Fundos *total return* incluem o reinvestimento dos dividendos e ganhos de capitais. Criação: 02/05/2024

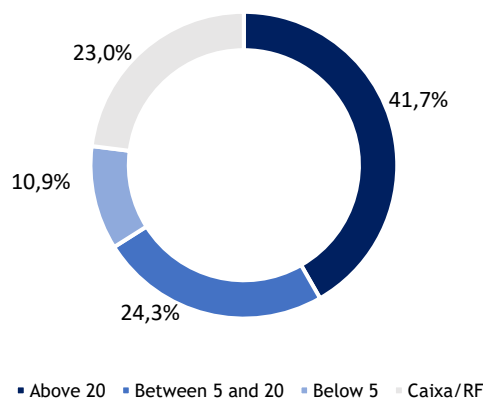
POLÍTICA DE INVESTIMENTO

A política de investimento do fundo consiste em proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital a longo prazo, através de uma carteira diversificada em valores mobiliários, observadas as limitações previstas no regulamento e na regulamentação em vigor. O fundo utiliza sólida análise fundamentalista, macro e quantitativa para seleção dos ativos, com uma carteira diversificada, composta essencialmente por ações, podendo também investir em renda fixa, câmbio e commodities, utilizando posições compradas e vendidas, sem alavancagem, bem como instrumentos do mercado à vista ou derivativos.

Risco de Market Cap



Risco de Liquidez



Exposição calculada em % da parcela de ações. *Large Cap* (acima de R\$ 20 Bilhões) *Mid Cap* (entre R\$ 20 bilhões e R\$ 5 bilhões); *Small Caps* (menor que R\$ 5 bilhões)

Exposição calculada em % da parcela de ações. Liquidez diária média (em R\$ milhões) nos últimos 6 meses de exposição em renda variável.

OBB Zermatt Equity Total Return FIM

Lâmina de performance - Mensal

abril/2024

*Dados calculados até a data de criação da lâmina: 02/05/2024

ANO		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	SI
2024	OBB Zermatt (%)	-4,9%	2,9%	0,9%	-5,0%	-	-	-	-	-	-	-	-	-6,1%	9,6%
	Ibovespa	-4,8%	1,0%	-0,7%	-1,7%	-	-	-	-	-	-	-	-	-6,2%	13,8%
2023	OBB Zermatt (%)	3,7%	-5,1%	-1,4%	2,1%	3,0%	5,9%	6,4%	-2,8%	-1,2%	-2,8%	7,4%	5,8%	22,0%	16,7%
	Ibovespa	3,4%	-7,5%	-2,9%	2,5%	3,7%	9,0%	3,3%	-5,1%	0,7%	-2,9%	12,5%	5,4%	22,3%	21,2%
2022	OBB Zermatt (%)	-	-	-	-1,5%	-0,5%	-10,8%	4,8%	9,7%	-3,4%	4,8%	-5,1%	-0,9%	-4,3%	-4,3%
	Ibovespa	-	-	-	-2,5%	3,2%	-11,5%	4,7%	6,2%	0,5%	5,5%	-3,1%	-2,4%	-0,9%	-0,9%

SI: Since Inception

Exposição Setorial

Performance Setorial Mensal

Alocação do Portfólio (%)

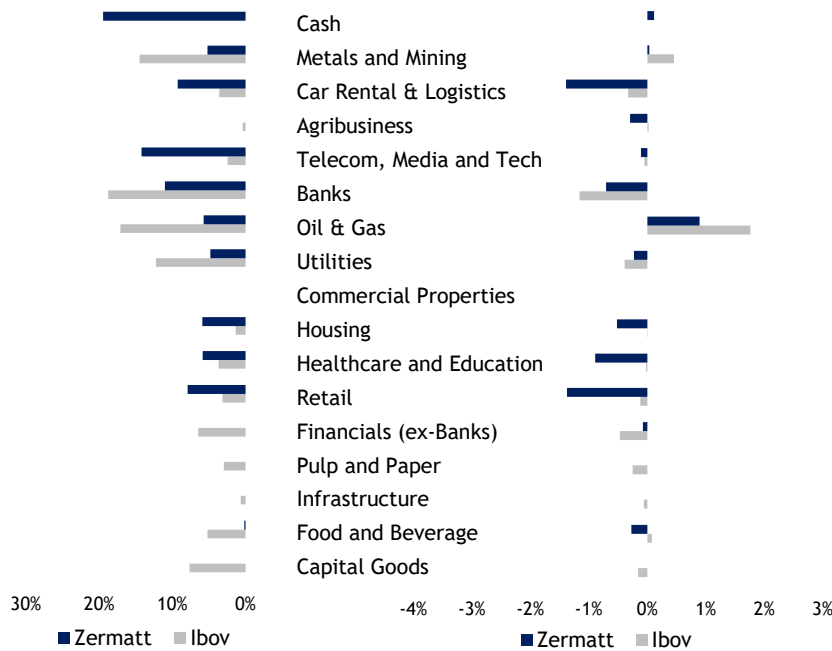
Equities	73%
Derivatives/Hedge	4%
Fixed Income	20%
Long & Short	7%

Portfólio (%)

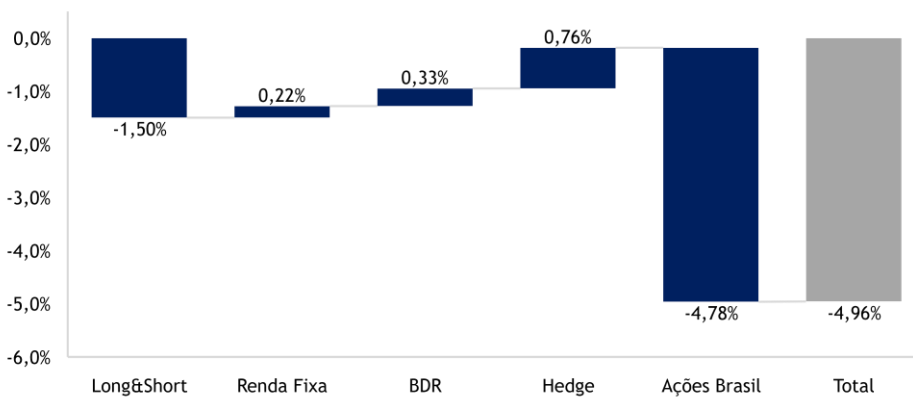
Top 5	31%
Gross (Long + Short)	89%
Net	77%

Métricas de Risco (anualizado)

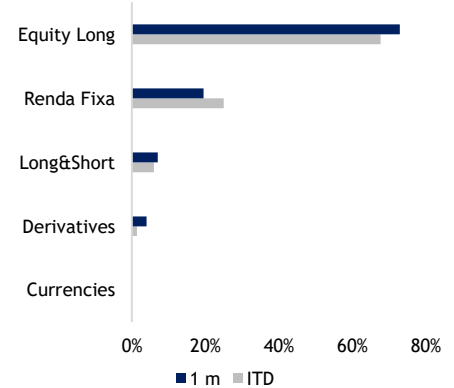
Beta	0,73
Sharpe	1,14
VOL Zermatt	12%
VOL IBOV	15%
VaR Zermatt	R\$ 58.394
VaR IBOV	R\$ 75.413



Performance Mensal Atribuída por Classe



Exposição por classe



Carta Trimestral Março 2024: <https://obbcapital.com.br/pt/conteudos/publicacoes/19-carta-do-gestor/281-carta-trimestral-marco-2024>

Glossário:

Exposição setorial - Setores definidos pela OBB Capital, calculado em função do percentual dos ativos no portfólio no dia de concepção do documento.
 Performance setorial - Calculada performance média do setor versus o tamanho da posição em carteira e Índice Ibovespa, desde o início do ano (ou data de início do fundo).
 Performance - Performance de 1 mês e 12 meses (ou desde a criação do fundo) dos ativos dentro do portfólio, considerando o tamanho da posição versus o total em ativos.
 Classe de Ativos - Classes definidas pela gestora; Renda fixa: Caixa; BDR: *Brazilian Depositary Receipts*; Hedge: Derivativos; Equity: Ações do Ibovespa.
 Currencies - Moedas.
 BETA - Índice de correlação e retorno, fundo OBB Capital Zermatt contra IBOVESPA.
 VOL - Índice de volatilidade.
 VaR - *Value at Risk*: Índice de perda máxima potencial do portfólio.
 Sharpe - Índice que compara o retorno do investimento em relação ao benchmark (IPCA+6%) sobre o risco.
 Small Caps - Ticker SMALL11 na Bovespa, inclui empresas selecionadas com valor de mercado abaixo de 2 Bilhões de Reais.
 P/L - Patrimônio Líquido do fundo.



Fonte: OBB Capital Asset Management

As informações contidas neste relatório/apresentação são de caráter exclusivamente informativo e não constituem qualquer tipo de aconselhamento de investimentos, não devendo ser utilizadas com esse propósito. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e o investimento em fundo não é garantido pelo Fundo Garantidor de Crédito. Os fundos poderão estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores com os riscos daí decorrentes. Nenhuma informação contida neste relatório/apresentação constitui uma solicitação, oferta ou recomendação para compra ou venda de cotas de qualquer fundo de investimento gerido pela OBB Capital ou de quaisquer outros valores mobiliários, nem poderá ser entendida como tal em qualquer jurisdição na qual tal solicitação, oferta ou recomendação sejam consideradas ilegais ou se sujeitem a regras específicas.