

OBJETIVO DO FUNDO

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

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

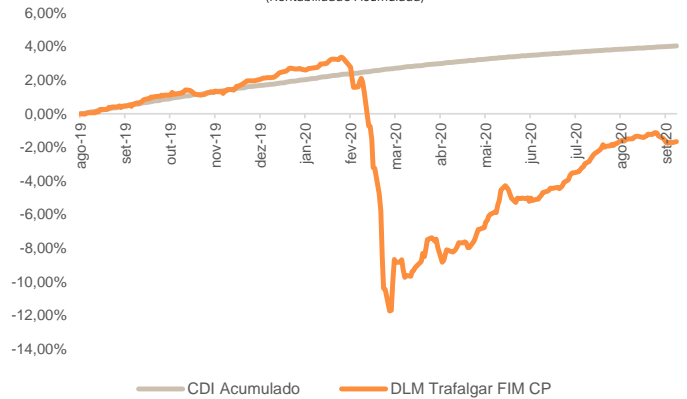
A política de investimento do fundo consiste em alocações em títulos públicos e privados, tanto no Brasil quanto no exterior. O fundo realiza hedge cambial para a parcela dos investimentos no exterior (limitados a 40% do PL do fundo), mitigando o risco cambial e atrelando sua remuneração a um percentual 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
Fundo	0,58%	-1,13%	-10,09%	0,64%	2,30%	0,95%	2,23%	1,52%	-0,16%				-3,70%	-1,65%
2020 CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%				2,29%	4,04%
%CDI	154,11%	-	-	223,92%	965,50%	442,78%	1146,27%	945,80%	-				-	-

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
Fundo									0,47%	0,69%	0,14%	0,82%	2,13%	2,13%
2019 CDI									0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	1,71%	1,71%
%CDI									101,34%	142,59%	36,08%	216,59%	124,01%	124,01%

RENTABILIDADE

	Fundo	% CDI
Acumulada desde o início	-1,65%	-
Últimos 12 meses	-2,12%	-
Últimos 24 meses	-	-
Últimos 36 meses	-	-

ANÁLISE ESTATÍSTICA

Patrimônio Atual	R\$ 115.393.686,84
Patrimônio Médio*	R\$ 105.832.216,14
Nº de meses acima do CDI	9
Nº de meses abaixo do CDI	4
Nº de meses positivos	10
Nº de meses negativos	3
Maior retorno mensal	2,30%
Menor retorno mensal	-10,09%

* Desde o início

MEDIDAS DE RISCO*

Var	2,99%
Volatilidade	6,31%
Índice de Sharpe	-

* Desde o início

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA ATUAL

CDB	0%
Letras Financeiras	6%
Debêntures	35%
Operações Estruturadas	0%
FIDC	3%
Offshore	38%
Caixa	18%

DISTRIBUIÇÃO POR RATING⁴

< A	0%
A	11%
AA	63%
AAA	26%

DISTRIBUIÇÃO POR SETOR⁴

Concessões	2,67%
Consumo cíclico	0,92%
Consumo não cíclico	5,53%
Energia	5,69%
FIDC	3,33%
Imobiliário	4,85%
Locação de Veículos	6,43%
Papel / Celulose	0,78%
Petroquímico	1,01%
Portuário	0,45%
Saneamento	3,46%
Saúde	0,78%
Setor Financeiro	8,17%
Distribuição de gás	0,84%
TOTAL EM CRÉDITO PRIVADO	44,92%

CARACTERÍSTICAS

Fundo: DLM Trafalgar Fundo de Investimento Multimercado Crédito Privado

Gestão: Inter Asset 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



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 Inter Asset 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.interasset.com.br. Supervisão e fiscalização - Comissão de Valores Mobiliários (CVM) / Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.