

# Schroder GAIA Blue Trend

acessado pelo fundo Systematica Blue Trend Dólar Advisory FICFIMIE

Material Publicitário

Schroder GAIA Blue Trend Dólar Advisory busca proporcionar crescimento de capital através de gestão ativa por meio de um sofisticado sistema informatizado de análise quantitativa que identifica tendências e oportunidades de mercado sem hedge cambial.

## Sobre a Systematica



Patrimônio sob gestão: **USD 16 Bilhões**



Time experiente, dedicado ao mundo quantitativo e gerindo fundos **desde 2004**



Presença global **142 funcionários e 6 escritórios** ao redor do mundo. Negociações em mais de 25 países.



Filosofia de investimento baseada em processo de **research disciplinado, inovação tecnológica e excelência operacional.**

Fonte: Systematica, em dezembro de 2023

## Sobre a Gestora



**Leda Braga**  
Systematica  
CEO & Gestora do Fundo

Formada em Engenharia pela PUC-RJ, mudou-se para Londres em 1987. Lá fez doutorado em Engenharia no Imperial College London. No Reino Unido, foi professora universitária e liderou projetos de pesquisa científica durante o período. Além disso, Leda teve cargos importantes no Centro Europeu de Pesquisa Nuclear (CERN), em Genebra, e no Centro de Risco Sistêmico da Escola de Economia de Londres.

Leda ingressou no mercado como analista de derivativos no JP Morgan Chase em 1993, onde atuou até 2004 quando recebeu o convite para fundar o braço quantitativo da BlueCrest Capital, onde passou a administrar o seu próprio fundo multimercado seguidor de tendência – o BlueTrend que possui mais de 18 anos de histórico.

A Systematica como conhecemos nasceu em 2015 através do *spin-off* do braço quantitativo da BlueCrest.

## Classe de Ativo

- Renda Fixa       Ações – IE  
 **Multimercado – IE**       Balanceado

## Sobre o fundo internacional

Diversificação: o fundo investe em aproximadamente 200 ativos internacionalmente

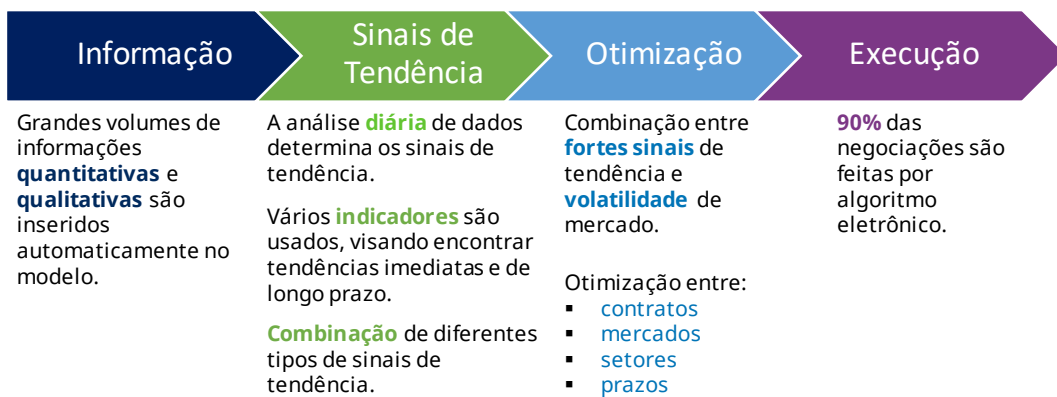
*Target* de Volatilidade: 12 - 15% a.a.  
Objetivo de Retorno: 9 - 11% a.a. (em USD)

Risco dividido em 4 classes de ativos:

- Moedas
- Taxas de juros
- Ações
- Commodities

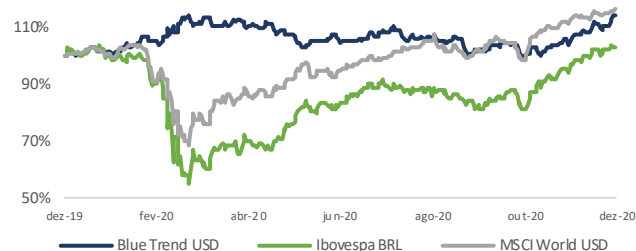
# Processo de Investimentos

## Como funciona o modelo?

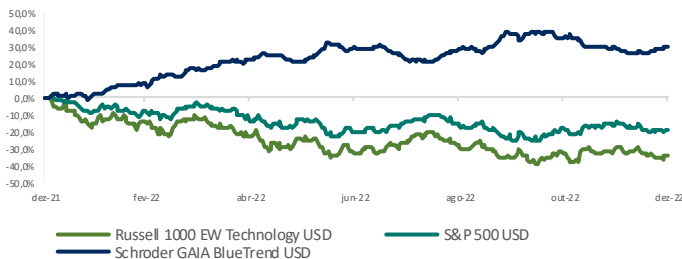


## Proteção de Drawdown

Retornos em 2020



Retornos em 2022

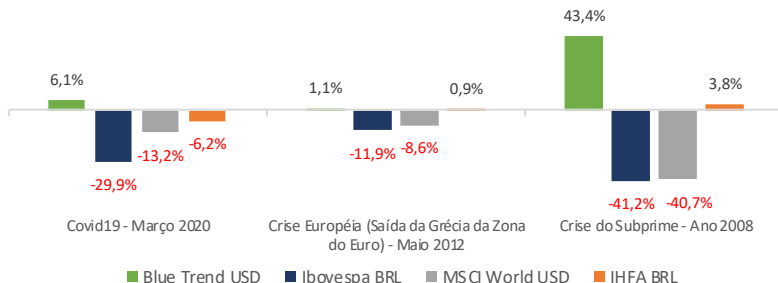


Índices apresentados como mera referência econômica e não metas ou parâmetros de performance (benchmark). O Fundo não possui benchmark.

## Dados estatísticos

Correlações (Out/10 – Jul/23)	Simulação Blue Trend BRL Unhedged
Ibovespa	-0,50
IHFA	-0,13
IMA-B	-0,32
MSCI World NR USD	-0,40
S&P 500 TR USD	-0,36

### Proteção em períodos de stress



Há informações presentes neste material técnico que são baseadas em simulações e os resultados reais poderão ser significativamente diferentes. A simulação de performance não considera taxa de administração e não é líquida de impostos e demais encargos. Valores simulados até 31/07/2023. Índices apresentados como mera referência econômica e não metas ou parâmetros de performance (benchmark). O Fundo não possui benchmark.

## Sobre a Schrodgers



US\$ 956.9 bilhões sob gestão em ações, renda fixa, *multi-asset*, alternativos e *real estate*.



Presente em 38 países na Europa, Américas, Ásia, Oriente Médio e África.



Presente no Brasil há mais de 30 anos. Entre as 25 maiores gestoras independentes do país.



Uma extensiva rede global de mais de 6.100 funcionários.



Mais de 220 anos de experiência em investimentos.

Fonte: Schrodgers, dezembro de 2023; \*Ranking de Gestores de Fundos de Investimento divulgado pela Anbima - fev/24

Este material foi preparado pela Schrodgers e não deve ser entendido como uma análise de quaisquer valores mobiliários, material publicitário, proposta de compra ou venda, oferta ou recomendação de quaisquer ativos financeiros ou de investimento. Este material é meramente informativo e não considera os objetivos de investimento, as condições financeiras, ou as necessidades particulares e específicas de quaisquer quotistas do Fundo ou outros investidores. As opiniões expressas neste material são da Schrodgers e podem mudar a qualquer momento. As opiniões são baseadas na data de sua apresentação e não consideram qualquer fato que possa ter surgido após esta data, não sendo a obrigação da Schrodgers atualizar este material para refletir ocorridos após sua apresentação. ESTE MATERIAL É ALTAMENTE CONFIDENCIAL E NÃO PODE SER REPRODUZIDO OU DISTRIBUÍDO, NO TODO OU EM PARTE, PARA OUTRAS PESSOAS QUE NÃO OS DESTINATÁRIOS ORIGINAIS. Leia o formulário de informações complementares, a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Investimento em Fundo não é garantido pelo Fundo Garantidor de Crédito. Caso o índice comparativo de rentabilidade utilizado neste material não seja o parâmetro objetivo do fundo (benchmark oficial), tal indicador é meramente apresentado como referência econômica. Supervisão e Fiscalização: Comissão de Valores Mobiliários - CVM. Serviço de Atendimento ao Cidadão em [www.cvm.gov.br](http://www.cvm.gov.br). As informações presentes neste material técnico são baseadas em simulações e os resultados reais poderão ser significativamente diferentes. O Schrodgers GAIA BlueTrend e a distribuição de suas quotas não foram registradas perante à Comissão de Valores Mobiliários - "CVM", e, portanto não atendem certos requisitos e procedimentos usualmente observados em ofertas públicas de valores mobiliários registradas perante à CVM, com os quais os investidores no mercado de capitais brasileiro podem estar familiarizados. Por esse motivo, o acesso dos investidores a certas informações sobre o Fundo pode ser restrito. OS FUNDOS DE INVESTIMENTO GERIDOS PELA SCHRODDERS NÃO CONTAM COM GARANTIA DA SCHRODDERS. O Schrodgers GAIA BlueTrend é acessado por fundos de investimento constituídos no Brasil distribuídos pela XP. AXP é a única instituição autorizada a prestar informações e a distribuir os fundos de investimento no Brasil. Qualquer dúvida sobre as informações constantes deste material deverão ser encaminhadas diretamente à XP.