

Schroder TS Diversified BRL Seleção IE FIC FIM

Material Publicitário

Schroder GAIA Two Sigma Diversified é uma estratégia sistemática. A estratégia consiste em investimento neutro no mercado de ações americano e uma estratégia macro Global. O fundo visa a geração de alfa, com volatilidade controlada, em uma ampla gama de condições de mercado por meio da aplicação sistemática de estratégias e técnicas de geração de alfa em mercados globais.

Quem é Two Sigma?



- Two Sigma tem **uma história de mais de 20 anos em gestão de investimentos**
- Uma empresa de tecnologia aplicando suas expertises para o domínio das finanças
- Almeja implantar e buscar continuamente o aprimoramento da inteligência do sistema de gestão de investimento criado em 2001.
- **Possui sob gestão de ativos aproximadamente \$58bn¹** para uma base de investimentos diversificada e global em mandatos de retornos absolutos e de gestão ativa.
- **Negocia ações, futuros, câmbio e derivativos em mais de 40 países**, utilizando um conjunto altamente diversificado de estratégias sistemáticas.
- **Engloba os talentos de mais de 1600 funcionários** sediados em Nova York, também com escritórios em Houston, Chicago, Stamford, London, Hong Kong, Tokyo e Shanghai.
- Um vasto recurso de mais de 990 pesquisadores, engenheiros e desenvolvedores, dedicados ao aprimoramento e desenvolvimento dos modelos proprietários e conjunto de dados do Two Sigma, do qual o fundo GAIA é beneficiário.
- Acesso à mais de 10,000 conjuntos de dados e mais de 20 petabytes por ano.

**One petabyte* é a quantidade de dados equivalente a 20 milhões de arquivos cheios de 500 bilhões de páginas de texto impressos.*

Sobre o Gestor

Ben Yospe Two Sigma Gestor do Fundo

Ben Yospe se juntou à Two Sigma em 2015 e atualmente atua como gestor de portfólio para Two Sigma Macro portfólio, LLC, Two Sigma Macro Risk Premia portfólio, LLC, e Schroder GAIA Two Sigma Diversified Fund. Como parte de suas responsabilidades, Ben supervisiona as atividades diárias do portfólio e pesquisa focados no aprimoramento dos processos de investimento. Anteriormente, Ben desempenhou vários papéis na empresa, onde suas responsabilidades incluíam atividades de gestão de portfólio e pesquisa, juntamente com modelagem macro. Antes de se juntar a empresa, trabalhou na AQR Capital Management como global macro associate, na qual realizou uma ampla gama de pesquisa de implementação de portfólio e previsão de retornos macro. Atuou também, como analista de investimentos na DC Energy. Ben possui mestrado e bacharelado em matemática aplicada e estatística pela universidade Johns Hopkins University.

Universo de Investimentos

Schroder GAIA Two Sigma Diversified Fund possui duas frentes, **US Equity Market Neutral (EMN)** e **Global Macro (Macro)**. Em relação a alocação dos portfólios, a divisão entre EMN e Macro é de 85% e 15%, respectivamente. No entanto, **quando ajustamos a alocação pelo risco** a divisão se torna a 60% e 40%, respectivamente.

Two Sigma utiliza uma abordagem baseada em modelos sistemáticos para investir. Os modelos são categorizados em 4 tipos. O EMN apresenta as 4 frentes, enquanto a Macro só emprega modelos técnicos e fundamentalistas. **A frente Macro opera em classes de ativos incluindo crédito, câmbio, ações e renda fixa, enquanto o EMN só adquire posições em ações americanas.**



Sobre a Schrodgers

- US\$ 939.2 bilhões sob gestão em ações, renda fixa, *multi-asset*, alternativos e *real estate*.
- Presente em 37 países na Europa, Américas, Ásia, Oriente Médio e África.
- Presente no Brasil há mais de 28 anos. Entre as 20 maiores gestoras independentes do país.
- Uma extensiva rede global de mais de 5.800 funcionários.
- Mais de 215 anos de experiência em investimentos.

Aspectos Operacionais

| | | | | | | | |
|-----------------------------------|-------------------------------------|--|--|---|---|---|---|
| CNPJ 41.994.550/0001-50 | Data de Início 14/07/2021 | Taxa de Administração 0,10% a.a. | Taxa de Performance Não há | Aplicação Mínima Não há | Benchmark CDI | Dia e Horário de Movimentação Diário até 14:00 (Brasília) | |
| Cota de Aplicação D+0 | Cota de Resgate D+7 | Liquidação de Aplicação D+0 | Liquidação de Resgate D+6 da cotização | Tributação Perseguida Longo Prazo | Classificação Anbima Multimercado Invest. no Exterior | Público-Alvo Investidores Qualificados | PL Fundo Global USD 686 milhões |

Este material foi preparado pela Schroder Investment Management Brasil Ltda ("Schroder") 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 tem propósito exclusivamente 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 nesse material são da Schroder 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 obrigação da Schroder atualizar este material para refletir ocorridos após sua apresentação. A Schroder não comercializa ou distribui quotas de fundos de investimentos ou qualquer outro ativo financeiro. ESTE MATERIAL 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. As informações presentes neste material técnico são baseadas em simulações e os resultados reais poderão ser significativamente diferentes. DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA DISPONÍVEL NO FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES. Supervisão e Fiscalização: Comissão de Valores Mobiliários - CVM. Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br. O regulamento do fundo pode ser obtido em www.itau.com.br.