

Período Analisado: De 27/11/2017 a 31/12/2019

| Estadísticas básicas | Fundo | SMALL CAP |
|--|---------|-----------|
| Retorno Acumulado Total | 66,83% | 76,15% |
| Pior Retorno Diário | -5,43% | -4,70% |
| % Ret. Abaixo do Benchmark Primário | 52,47% | 0,00% |
| % Retornos Negativos | 46,97% | 42,23% |
| Maior Queda em um Intervalo (Drop Max) | -18,20% | -18,81% |
| Volatilidade Anualizada | 21,83% | 17,87% |
| Volatilidade Negativa Anualizada vs 0 (Down Vol 1) | 14,65% | 12,00% |
| Beta para Benchmark Primário | 1,12 | 1,00 |
| Alpha para Benchmark Primário | -0,02% | 0,00% |
| R2 para Benchmark Primário | 83,88% | 100,00% |
| Tracking Error para Benchmark Primário | 0,57% | 0,00% |
| Sortino Ratio | 1,466 | 2,070 |
| Sharpe Ratio | 0,984 | 1,391 |
| Appraisal Ratio (Alpha / RR) | -0,13% | 0,00% |
| I. Ratio 2 (AV/TE) | -16,39 | 0,00 |

Objetivo

Proporcionar ganhos de capital, buscando superar a valorização do índice SMLL em um horizonte de médio e longo prazo, concentrando e selecionando ativamente suas aplicações no mercado à vista de ações e através de instrumentos como futuros, swaps e opções, somente para Hedge.

Principais Estratégias

Renda variável, small caps, fundamentalista.

Política de Investimento

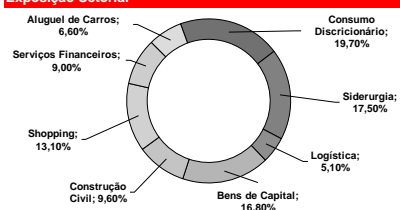
Manter um perfil de atuação agressivo, focando a preservação do capital selecionando ações de empresas de baixa capitalização ("small caps") que apresentem sólidos fundamentos e alto potencial de valorização no médio/longo prazo.

Público alvo

Adequado às Resoluções 4.661 e 4.695

O Fundo destina-se a receber aplicações de recursos provenientes de investidores institucionais, pessoas físicas e/ou jurídicas, bem como de fundos de investimento e/ou fundos de investimento em quotas nos termos da legislação vigente e que aceitem assumir riscos em função da política de investimento do Fundo.

Exposição Setorial



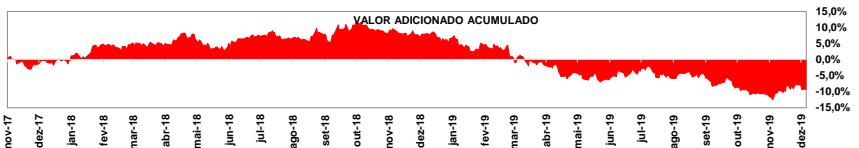
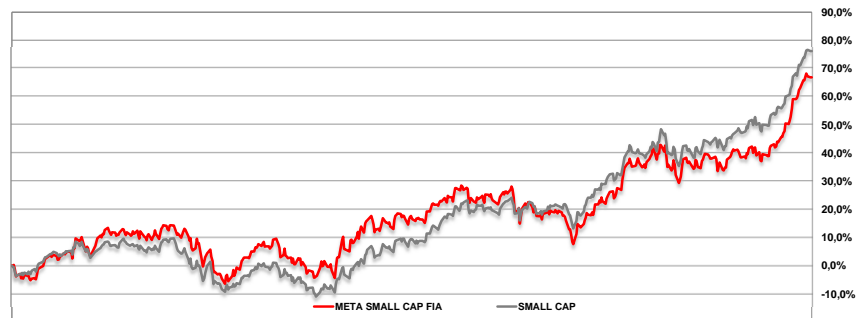
Prestadores de serviço

| | |
|----------------|--|
| Gestor: | META Asset Management Ltda. |
| Administrador: | Daycoval Asset Management Administração de Recursos LTDA |
| Distribuidor: | META Asset Management Ltda. |
| Custodiante: | Banco Daycoval |
| Auditor: | KPMG Auditores Independentes |

Informações adicionais

| | |
|-----------------------------|----------|
| Última cota: | 1,668314 |
| Data última cota: | 31/12/19 |
| PL Atual: | 3.445 |
| PL Médio 12 meses (R\$000): | 2.202 |
| Início das Atividades: | 24/11/17 |

Rentabilidade Acumulada (%)



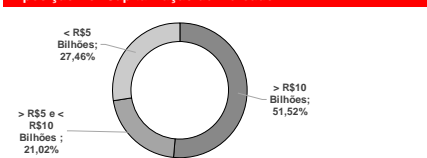
| | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | YTD |
|------|-------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|
| 2016 | Fundo | | | | | | | | | | | | |
| | Benchmark +/- p.p | | | | | | | | | | | | |
| 2017 | Fundo | | | | | | | | | | | | |
| | Benchmark +/- p.p | | | | | | | | | | | | |
| 2018 | 6,53% | 1,96% | 0,65% | 1,85% | -9,90% | -3,44% | 6,73% | -4,59% | -2,81% | 17,61% | 2,51% | 0,55% | 16,22% |
| | Benchmark +/- p.p | | | | | | | | | | | | 8,09 |
| 2019 | 7,33% | -3,22% | -2,90% | -0,48% | -1,34% | 7,99% | 9,39% | -1,24% | 0,69% | 0,58% | 3,04% | 16,06% | 39,93% |
| | Benchmark +/- p.p | | | | | | | | | | | | -18,27 |

Termos

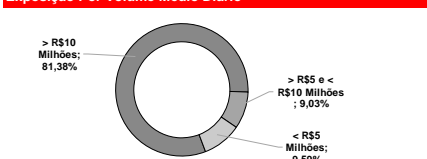
| | |
|-----------------------|--|
| Cotização Aplicação | D+1, da efetiva disponibilidade dos recursos |
| Cotização Resgate | D+1 (úteis) |
| Pagamento Resgate | D+2 da cotização |
| Tributação | Renda variável - 15% |
| Taxa de Administração | 2,5% a.a / max. 3,0%a.a. |
| Taxa de Performance | 20% sobre o ganho excedente ao SMLL |
| Categoria ANBIMA | Ações Ativo Small Caps |

| | |
|---------------------|----------------------|
| Nome: | META SMALL CAP FIA |
| CNPJ: | 28.648.839/0001-50 |
| Banco: | 707 / Banco Daycoval |
| Agência: | 001 |
| Conta: | 736731-9 |
| Horário Limite: | 14:00 |
| Aplicação Inicial | R\$ 5.000,00 |
| Movimentação Mínima | R\$ 5.000,00 |
| Saldo Mínimo | R\$ 5.000,00 |

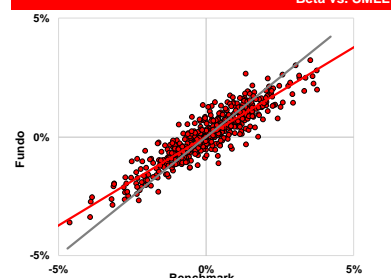
Exposição Por Capitalização de Mercado



Exposição Por Volume Médio Diário



Beta vs. SMLL



Gestor: www.metaasset.com.br / tel.: +55 (21) 3043-8100
Administrador: www.daycoval.com.br / tel.: 0800 7770900
Custodiante: www.daycoval.com.br / tel.: 0800 7770900



As informações contidas nesse material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do fundo garantidor de créditos - FGC. A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade do Fundo apresentada não é líquida de impostos. Ao investidor é indispensável a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Os fundos de renda variável podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.

Este fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento; tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Para avaliação da performance do fundo de investimentos, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 meses.

Avenida Niemeyer, 2 / 107
Leblon - Rio de Janeiro - RJ
Cep: 22450-220
Brasil

1
www.metaasset.com.br
contato@metaam.com.br