

Desempenho histórico

Ano	Data da primeira cota do fundo: 16/10/09												Ano		Acumulado	
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Fundo	Ibov	Fundo	Ibov
	2024	-3.43%	0.80%	1.06%	-5.67%	-2.99%	0.26%	3.43%	5.30%	-2.45%	-1.43%			-5.5%	-3.3%	315.3%
2023	3.83%	-6.16%	-2.82%	3.00%	6.03%	8.16%	1.45%	-4.87%	-1.00%	-4.68%			19.6%	22.3%	339.3%	102.7%
2022	3.88%	-0.97%	7.65%	-3.83%	2.66%	-10.77%	4.67%	6.87%	-1.08%	5.41%			2.1%	4.7%	267.3%	65.8%
2021	-3.95%	-2.57%	8.97%	5.27%	4.36%	-0.26%	-4.13%	-3.21%	-4.73%	-6.92%			-5.6%	-11.9%	259.9%	58.3%
2020	1.72%	-5.44%	-31.56%	8.90%	6.15%	7.00%	8.46%	-6.24%	-4.50%	-1.68%			6.28%	-6.2%	281.3%	79.8%
2019	11.81%	-1.46%	-1.68%	0.64%	3.17%	5.14%	5.14%	0.98%	1.39%	1.73%			50.9%	31.6%	306.6%	74.7%
2018	6.61%	2.21%	0.33%	-0.39%	-6.63%	-4.64%	7.88%	-2.77%	-1.92%	16.19%			22.9%	15.0%	169.5%	32.8%
2017	7.50%	4.37%	-1.29%	0.57%	-2.62%	0.51%	4.67%	8.94%	5.62%	0.01%			32.5%	26.9%	119.3%	15.4%
2016	-3.40%	0.11%	14.00%	7.03%	-0.91%	0.65%	9.89%	0.47%	0.43%	8.51%			35.4%	38.9%	65.5%	-9.0%
2015	-7.98%	7.37%	1.57%	5.67%	-3.86%	-1.38%	-1.58%	-6.05%	1.58%	0.64%			-8.8%	-13.3%	22.3%	-34.5%
2014	-5.56%	-1.05%	5.61%	2.54%	-0.29%	3.20%	2.19%	9.43%	-11.49%	-2.38%			-6.6%	-2.9%	34.1%	-24.5%
2013	0.00%	0.01%	3.41%	0.13%	1.60%	-7.89%	2.93%	0.48%	3.84%	6.92%			6.2%	-15.5%	42.1%	-22.2%
2012	5.62%	5.25%	1.48%	-0.80%	-10.65%	-5.27%	4.63%	2.34%	4.63%	2.57%			5.23%	19.7%	7.4%	33.7%
2011	-0.30%	0.72%	3.14%	-0.85%	-0.92%	-1.76%	-8.49%	-3.18%	-4.62%	10.52%			-8.1%	-18.1%	11.8%	-14.3%
2010	-1.30%	1.37%	1.75%	-1.99%	-4.80%	3.43%	6.74%	-0.61%	4.95%	3.72%			14.3%	1.0%	21.6%	4.7%
2009										-5.47%			6.4%	3.6%	6.4%	3.6%

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

O fundo busca superar o Índice Bovespa no longo prazo através de uma carteira diversificada de ações, utilizando-se de uma metodologia sistemática e baseada em fatores de risco para a seleção de ativos e construção do portfólio. A escolha das ações e a definição do tamanho das posições visa a minimização de volatilidade e perdas potenciais.

OBJETIVO

O fundo busca gerar retornos superiores ao Ibovespa no longo prazo.

PÚBLICO ALVO

Investidores em geral. O fundo respeita as disposições das resoluções 4994 e 4963 aplicáveis a regimes de previdência.

Retorno Acumulado

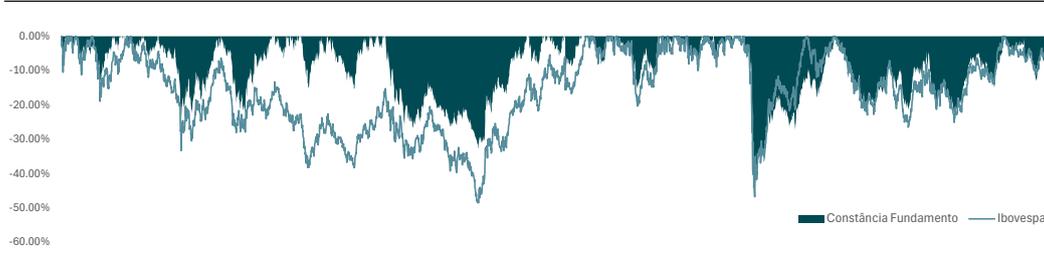


Dados Estatísticos - Desde o Início

	Retorno	Fundo	Ibovespa
Retorno Acumulado	315.26%	315.26%	95.94%
Retorno Médio aa	11.48%	11.48%	7.26%
Prêmio Médio sobre o cdi	2.50%	2.50%	-1.72%
Prêmio Médio sobre o Ibov	4.22%	4.22%	n/a

	Volatilidade	Fundo	Ibovespa
Standard Deviation	19.85%	19.85%	23.49%
Downside Deviation	15.63%	15.63%	17.25%
Sharpe Ratio	0.13	0.13	-0.07
Sortino Ratio	0.16	0.16	-0.10

Drawdown

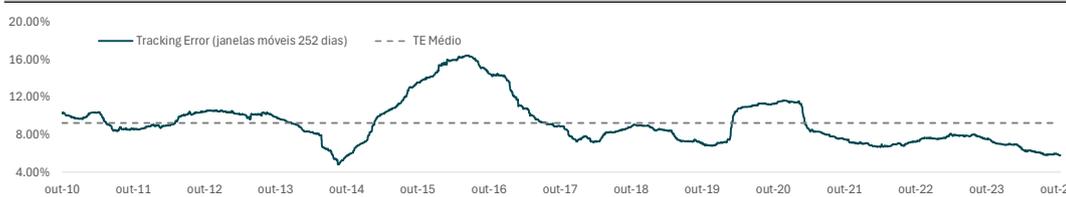


	Preservação de Capital	Fundo	Ibovespa
Maximum Drawdown	-45.39%	-45.39%	-48.63%
Drawdown Médio	-3.66%	-3.66%	-5.42%

	Benchmark	Fundo	Ibovespa
Excess Return aa	11.48%	11.48%	-
Batting Average	51.35%	51.35%	-
Up Capture	0.90	0.90	-
Down Capture	0.91	0.91	-
R-squared	0.84	0.84	-
Tracking Error	9.49%	9.49%	-
Information Ratio	1.21	1.21	-
Beta	0.78	0.78	-
Treynor Ratio	0.15	0.15	-
Alpha de Jensen	3.84%	3.84%	-

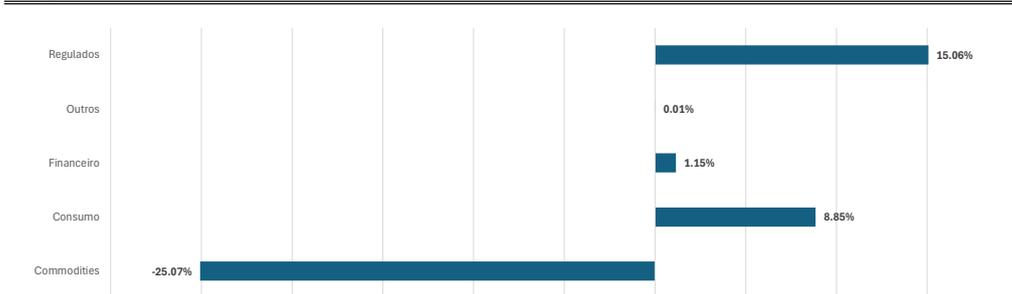
*Média excluindo os 5 maiores

Tracking Error (janelas móveis de 252 dias)



	Patrimônio Líquido	Fundo	Ibovespa
Fechamento Mês	R\$ 1,242,883,391	R\$ 1,242,883,391	-
Últimos 12 meses	R\$ 1,409,958,755	R\$ 1,409,958,755	-
Média desde o Início	R\$ 412,820,852	R\$ 412,820,852	-

Alocação Setorial (vs. IBOV)



	Portfólio	Fundo	Ibovespa
Número de posições compradas	110	110	-
Maior posição comprada (% PL)	96.4%	96.4%	-
Ações compradas (% PL)	4.6%	4.6%	-

Movimentações e Informações gerais

Aplicação inicial	R\$ 1,000	Razão Social	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	Banco	237 - Banco Bradesco	Taxa de Administração	2,00% a.a. (provisionado diariamente e cobrado mensalmente)
Movimentações	R\$ 1,000	CNPJ Fundo	11.182.064/0001-77	Agência	2856	Taxa de Performance	20% sobre o que exceder 100% do Ibovespa (provisionado diariamente e cobrado semestralmente, utilizando o conceito de linha d'água)
Saldo mínimo	R\$ 1,000	Gestor	Constância Investimentos Ltda.	Conta Corrente	29.924-3		
Tipo de quota	Fechamento	Custódia e Controladoria	BANCO BRADESCO S.A.	Classificação ANBIMA	Ações Livre		
Aplicação	D+1	Auditor	Deloitte	Código ANBIMA	236942		
Aplicação financeiro	D+0	Administrador/Distribuidor	BEM DTM	Código ISIN	BRNPF2CTF001		
Resgate-quotização (dias úteis)	D+14						
Resgate-pagamento (dias úteis)	D+15						