

# ASA Alpha Nominal Rates Institucional FIRF

Julho/2025



## OBJETIVO

O ASA Alpha Nominal Rates Institucional atua prioritariamente no mercado de juros pre-fixados. Com o objetivo de superar o IRF-M no longo prazo, o fundo pode adotar posições ativas tanto no mercado de juros nominais quanto reais, explorando oportunidades decorrentes das assimetrias de preços e da evolução dos fundamentos econômicos.

## POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O ASA Alpha Nominal Rates Institucional realiza operações nas classes de juros nominais e reais, podendo adotar estratégias de duration management, seleção de títulos e valor relativo, utilizando-se dos instrumentos de renda fixa disponíveis nos mercados à vista e de derivativos.

## PÚBLICO ALVO

Público geral.

## INDICADORES RENTABILIDADE ACUMULADA

|                                       |                |
|---------------------------------------|----------------|
| Patrimônio Líquido                    | R\$ 59.884.177 |
| Patrimônio Líquido (últimos 12 meses) | R\$ 60.358.987 |
| Volatilidade (últimos 12 meses)       | 5,41%          |
| Information Ratio (últimos 12 meses)  | -0,60          |
| Meses Positivos                       | 33             |
| Meses Negativos                       | 8              |
| Maior Retorno Mensal                  | 6,59%          |
| Menor Retorno Mensal                  | -4,15%         |

Período dos dados: 25/03/2022 a 31/07/2025.

## RENTABILIDADE DO FUNDO E RENTABILIDADE ACIMA DO IRF-M (MENSAL)

| ANO         | JAN    | FEV    | MAR    | ABR    | MAI    | JUN    | JUL    | AGO    | SET    | OUT    | NOV    | DEZ    | ANO    | INÍCIO |
|-------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2025        | 6,59%  | -0,09% | 1,55%  | 3,31%  | 0,63%  | 0,70%  | -0,56% | -      | -      | -      | -      | -      | 12,57% | 43,46% |
| acima IRF-M | 4,01%  | -0,70% | 0,16%  | 0,32%  | -0,36% | -1,08% | -0,86% | -      | -      | -      | -      | -      | 1,47%  | 1,52%  |
| 2024        | 0,34%  | 0,72%  | 0,25%  | -0,59% | 0,98%  | -0,68% | 1,80%  | 0,41%  | -0,18% | -0,27% | 0,08%  | -4,15% | -1,39% | 27,44% |
| acima IRF-M | -0,32% | 0,25%  | -0,29% | -0,07% | 0,32%  | -0,38% | 0,46%  | -0,25% | -0,52% | -0,48% | 0,61%  | -2,49% | -3,25% | -0,32% |
| 2023        | 1,28%  | 1,09%  | 2,46%  | 1,75%  | 2,13%  | 2,40%  | 0,92%  | 0,47%  | 0,18%  | 0,21%  | 1,90%  | 1,75%  | 17,80% | 29,24% |
| acima IRF-M | 0,45%  | 0,22%  | 0,32%  | 0,65%  | -0,07% | 0,27%  | 0,03%  | -0,29% | 0,01%  | -0,17% | -0,57% | 0,27%  | 1,29%  | 3,81%  |
| 2022        | -      | -      | 0,26%  | 0,24%  | 0,69%  | 0,23%  | 2,23%  | 2,47%  | 1,32%  | 0,94%  | -0,42% | 1,38%  | 9,71%  | 9,71%  |
| acima IRF-M | -      | -      | 0,00%  | 0,36%  | 0,11%  | -0,13% | 1,08%  | 0,41%  | -0,08% | 0,02%  | 0,23%  | -0,10% | 2,05%  | 2,05%  |

## RENTABILIDADE DO FUNDO E RENTABILIDADE ACIMA DO IRF-M (PERÍODO)

|                                            | MÊS    | ANO    | 6 MESES | 12 MESES | 24 MESES | 36 MESES | INÍCIO |
|--------------------------------------------|--------|--------|---------|----------|----------|----------|--------|
| ASA Alpha Nominal Rates Institucional FIRF | -0,56% | 12,57% | 5,61%   | 7,95%    | 16,08%   | 38,34%   | 43,46% |
| acima IRF-M                                | -0,86% | 1,47%  | -2,69%  | -2,06%   | -3,14%   | -0,47%   | 1,52%  |

\* Rentabilidade acumulada e calculada desde o início do fundo, a partir de 25/03/2022.

## INFORMAÇÕES GERAIS

|                       |                            |                                  |                                                   |
|-----------------------|----------------------------|----------------------------------|---------------------------------------------------|
| Início das Atividades | 25/03/2022                 | CNPJ                             | 44.917.343/0001-90                                |
| Público-alvo          | Público geral              | Classificação ANBIMA             | Renda Fixa / Duração Livre / Grau de Investimento |
| Taxa de Administração | 0,06% a.a.                 | Aplicação Mínima                 | R\$ 10.000,00                                     |
| Taxa de Gestão        | 0,44% a.a.                 | Movimentação Mínima              | R\$ 5.000,00                                      |
| Taxa de Performance   | Não há                     | Saldo Mínimo                     | R\$ 5.000,00                                      |
| Taxa de Saída         | Não há                     | Horário Limite para Movimentação | 16:00                                             |
| Taxa Global           | Não há                     | Aplicação                        | Cotização em D+0                                  |
| Tributação IR*        | Longo Prazo                | Resgate                          | Cotização em D+0 e Liquidação em D+ 1             |
| Administrador         | S3 CACEIS BRASIL DTVM S.A. | Resgate Antecipado               | Não há                                            |
| Custodiante           | S3 CACEIS BRASIL DTVM S.A. | Auditor Independente             | PRICEWATERHOUSECOOPERS BRASIL LTDA.               |

contato@asa.com.br

(11) 4004-9055

Alameda Santos, 2159, Cj 52, Consolação, São Paulo, SP

ASA ALPHA NOMINAL RATES INSTITUCIONAL CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA - \*Taxa de Administração e Gestão Máxima é de 0,60% a.a. \*\*Não há garantia de que o Fundo terá tratamento tributário de longo prazo. A alteração nas referidas alíquotas, ainda que gere ônus para o cotista, não pode ser interpretada como responsabilidade do Administrador ou da Gestora dado que a gestão da carteira e suas repercussões fiscais dão-se em regime de melhores esforços e como obrigação de meio, pelo que Administrador e a Gestora não garantem qualquer resultado, mesmo que de natureza fiscal. Estas informações são de caráter informativo, não se caracterizando como oferta de valores mobiliários, cujas características poderão ou não se enquadrar ao perfil do investidor, nos termos da Resolução CVM 30/21. Antes de investir, leia a lâmina de informações essenciais, o formulário de informações complementares, o regulamento, em conjunto com anexo e apêndice, e os demais materiais relacionados ao fundo que estão disponíveis no website do Administrador. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada já é líquida das taxas de administração, de performance e dos outros custos pertinentes aos fundos. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Os fundos podem utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimentos. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Este conteúdo não pode ser copiado, reproduzido, publicado, retransmitido ou distribuído, no todo ou em parte, por qualquer meio e modo, sem a prévia e expressa autorização, por escrito, da ASA.

