

Objetivo e Público Alvo

O fundo é destinado a investidores interessados em títulos públicos, sendo opção ao Tesouro Direto.

Com o uso de algoritmo, Deep Blue faz aplicações em Notas do Tesouro Nacional - Série B com vencimento de até 5 anos, realizando balanceamento com títulos vinculados à taxa Selic conforme cenário de juros.

O fundo é destinado ao público em geral nos termos da regulamentação em vigor.

Política de Investimento

O Smart Fund Deep Blue FIM é composto exclusivamente por títulos públicos com prazo de até cinco anos e utiliza como parâmetro o índice IMA-B5.

Conforme ambiente de risco e cenário de juros, algoritmos definem alocação e balanceamento dessa carteira com o objetivo de reduzir a volatilidade e ampliar o retorno.

Nenhuma posição em crédito privado é permitida, o que torna o fundo um puro investidor de risco soberano de país.

Instrumentos de caixa poderão ocupar no máximo 10% da posição.

Visando ampliar ganhos, o fundo trabalha com uma alavancagem máxima de 28% da sua posição.

Rentabilidade ³

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum
2020														
Fundo	0,50%	0,62%	-1,90%	0,40%	2,01%	1,10%	0,97%	0,30%	-0,22%	0,13%	1,41%	1,76%	7,25%	33,15%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%	16,62%
% CDI	133,5%	210,8%	-	139,9%	843,0%	510,5%	499,2%	183,7%	-	85,5%	944,6%	1067,4%	262,04%	199,47%
2019														
Fundo	1,54%	0,50%	0,77%	1,07%	1,43%	1,79%	0,98%	-0,13%	1,83%	1,69%	-0,38%	1,25%	13,00%	24,15%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	13,48%
% CDI	283,0%	101,0%	163,3%	206,0%	262,6%	381,7%	172,5%	-	392,0%	352,2%	-	331,04%	217,91%	179,15%
2018														
Fundo	1,18%	0,48%	1,52%	0,35%	-1,61%	0,37%	1,48%	-0,41%	0,86%	3,23%	0,06%	1,38%	9,16%	9,86%
CDI	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	7,09%
% CDI	203,1%	103,3%	284,8%	67,6%	-	72,2%	273,0%	-	182,6%	593,9%	11,4%	278,8%	142,65%	139,12%
2017														
Fundo													-0,09%	0,73%
CDI													0,08%	0,54%
% CDI													-	135,5%
													0,64%	0,64%
													0,62%	0,62%
													102,4%	102,4%

Análise de Retorno ^{1,2}

PL do Fundo : R\$ 10.209.833,12
 PL médio (12 meses): R\$ 7.869.137,98

Desvio padrão desde início: 3,66%
 Índice Sharpe (anualizado): 1,39

Grau de Risco:



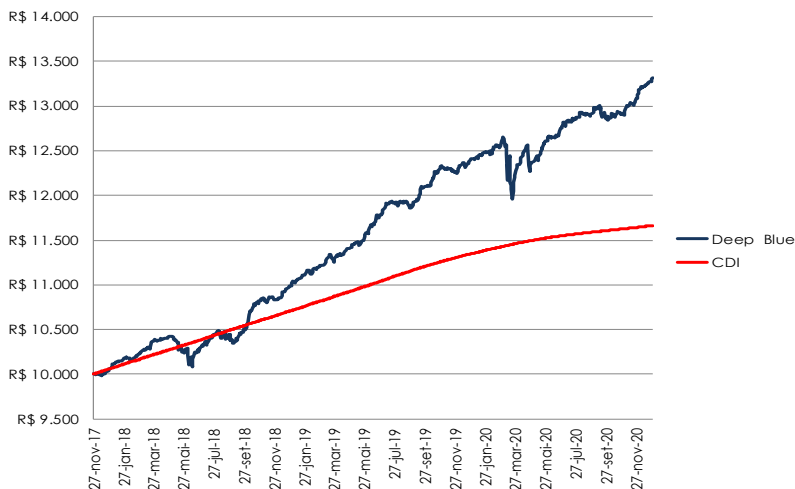
Meses acima do CDI: 27
 Meses abaixo do CDI: 11
 Maior retorno mensal: 3,23%
 Menor retorno mensal: -1,90%

Benchmark: CDI
 Data de início: 27/11/17

Valor da Cota Líquida (31/12/2020): 1,33151950



Performance acumulada ³



¹ Média aritmética do patrimônio líquido do fundo no último dia útil de cada mês desde o início do fundo. ² Desvio padrão das cotas diárias de 27/11/17 até o fechamento do relatório. ³ Rentabilidade líquida das taxas de administração e performance, mas não de impostos.

Gestão:

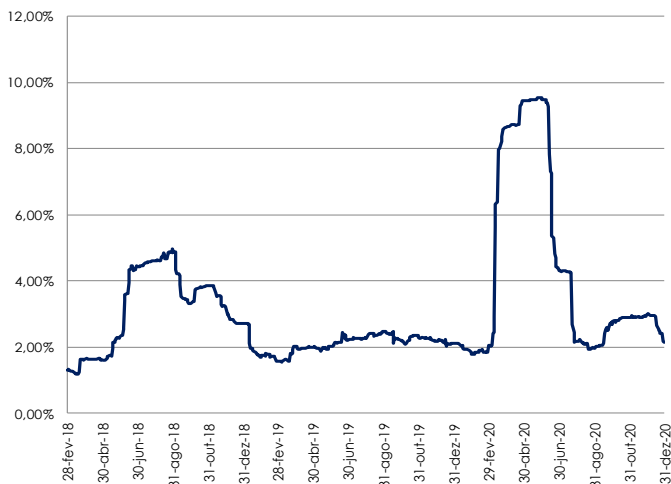
TITAN CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Supervisão e Fiscalização:

Comissão de Valores Mobiliários - CVM
 Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br

AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE MATERIAL POSSUEM CARÁTER MERAMENTE INFORMATIVO. A TITAN CAPITAL NÃO COMERCIALIZA, NEM DISTRIBUI COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS. O SMART FUND DEEP BLUE FIM POSSUI DATAS DISTINTAS DE CONVERSÃO E DE PAGAMENTO DO RESGATE DE COTAS. O PAGAMENTO DO RESGATE É REALIZADO, CONFORME DEFINIDO NO REGULAMENTO DO CAPÍTULO REFERENTE AS REGRAS DE MOVIMENTAÇÃO. NÃO HÁ GARANTIA DE QUE O FUNDO TERÁ O TRATAMENTO TRIBUTÁRIO DE LONGO PRAZO. AS RENTABILIDADES DIVULGADAS SÃO LÍQUIDAS DAS TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO, MAS NÃO SÃO LÍQUIDAS DE IMPOSTOS. AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE MATERIAL SÃO DE CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO E ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO SMART FUND DEEP BLUE FIM. FUNDOS DE INVESTIMENTOS NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR. DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC. A RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. AO INVESTIDOR É INDISPENSÁVEL A LEITURA CUIDADOSA DA LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E DO REGULAMENTO DO FUNDO DE INVESTIMENTO AO APLICAR SEUS RECURSOS. O INVESTIDOR PODE ENCONTRAR O REGULAMENTO E A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS NO LINK [HTTP://TITANCAPITAL.COM.BR/FUNDOS-DE-INVESTIMENTO/SMART-FUND-DEEP-BLUE-FIM](http://titancapital.com.br/fundos-de-investimento/smart-fund-deep-blue-fim). ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS DE ALAVANCAGEM COMO PARTE INTEGRANTE DE SUA POLÍTICA DE INVESTIMENTO. TAIS ESTRATÉGIAS PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS QUOTISTAS.

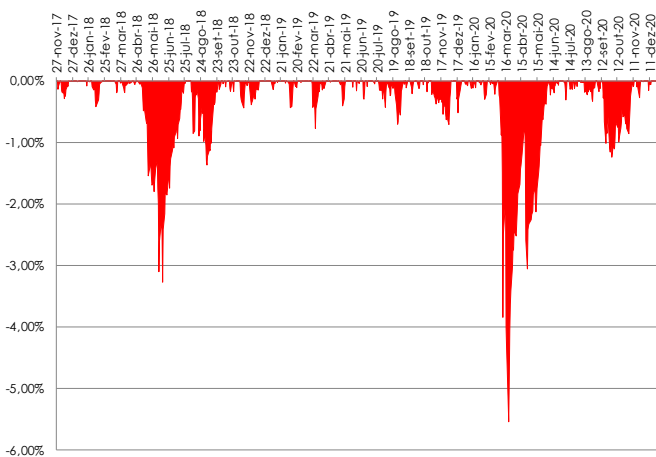
Volatilidade desde o início - janela móvel de três meses



Exposição – 5 maiores posições

Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	33,89%
Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23,18%
Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	21,30%
Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	16,42%
Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	10,25%

Drawdown



Dados do Fundo

Gestor: Titan Capital Gestão de Recursos Ltda.
Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros SA DTMV
Custodiante: Banco BTG Pactual SA
Auditoria: Ernst & Young Auditores Independentes
Classificação ANBIMA: Multimercado Livre
Código ANBIMA: 453791
Tributação: de longo prazo
Taxa de Administração: 0,8% a.a.
Taxa de Administração Máxima: 0,9% a.a.
Taxa de Performance: Não há
Taxa de Entrada: Não há
Taxa de Saída: Não há
Período de Carência: Não há

Dados Bancários do Fundo

Banco: Banco BTG Pactual (nº 208)
Agência: 001
Conta do Fundo: 40513-3
Favorecido: Smart Fund Deep Blue FIM
CNPJ: 28.579.477/0001-92
Titular da Conta: Smart Fund Deep Blue FIM

Aplicações e Resgates

Aplicação inicial mínima: R\$ 0,00
Movimentação mínima: R\$ 0,00
Saldo mínimo: R\$ 0,00
Horário limite para movimentação: 14h
Cotização resgate: D+1
Liquidação resgate: D+3

Administração:



Distribuidores:



necton



Gestão de Recursos

Gestão:

TITAN CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Supervisão e Fiscalização:

Comissão de Valores Mobiliários - CVM
 Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br

AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE MATERIAL POSSUEM CARÁTER MERAMENTE INFORMATIVO. A TITAN CAPITAL NÃO COMERCIALIZA, NEM DISTRIBUI COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS. O SMART FUND DEEP BLUE FIM POSSUI DATAS DISTINTAS DE CONVERSÃO E DE PAGAMENTO DO RESGATE DE COTAS. O PAGAMENTO DO RESGATE É REALIZADO, CONFORME DEFINIDO NO REGULAMENTO DO FUNDOS DE INVESTIMENTOS. NÃO HÁ GARANTIA DE QUE O FUNDO TERÁ O TRATAMENTO TRIBUTÁRIO DE LONGO PRAZO. AS RENTABILIDADES DIVULGADAS SÃO LÍQUIDAS DAS TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO, MAS NÃO SÃO LÍQUIDAS DE IMPOSTOS. AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE MATERIAL SÃO DE CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO E ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO SMART FUND DEEP BLUE FIM. FUNDOS DE INVESTIMENTOS NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR. DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC. A RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. AO INVESTIDOR É INDISPENSÁVEL A LEITURA CUIDADOSA DA LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E DO REGULAMENTO DO FUNDO DE INVESTIMENTO AO APLICAR SEUS RECURSOS. O INVESTIDOR PODE ENCONTRAR O REGULAMENTO E A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS NO LINK [HTTP://TITANCAPITAL.COM.BR/FUNDOS-DE-INVESTIMENTO/SMART-FUND-DEEP-BLUE-FIM](http://TITANCAPITAL.COM.BR/FUNDOS-DE-INVESTIMENTO/SMART-FUND-DEEP-BLUE-FIM). ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS DE ALAVANCAGEM COMO PARTE INTEGRANTE DE SUA POLÍTICA DE INVESTIMENTO. TAIS ESTRATÉGIAS PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS QUOTISTAS.