CLUBE DE INVESTIMENTOS

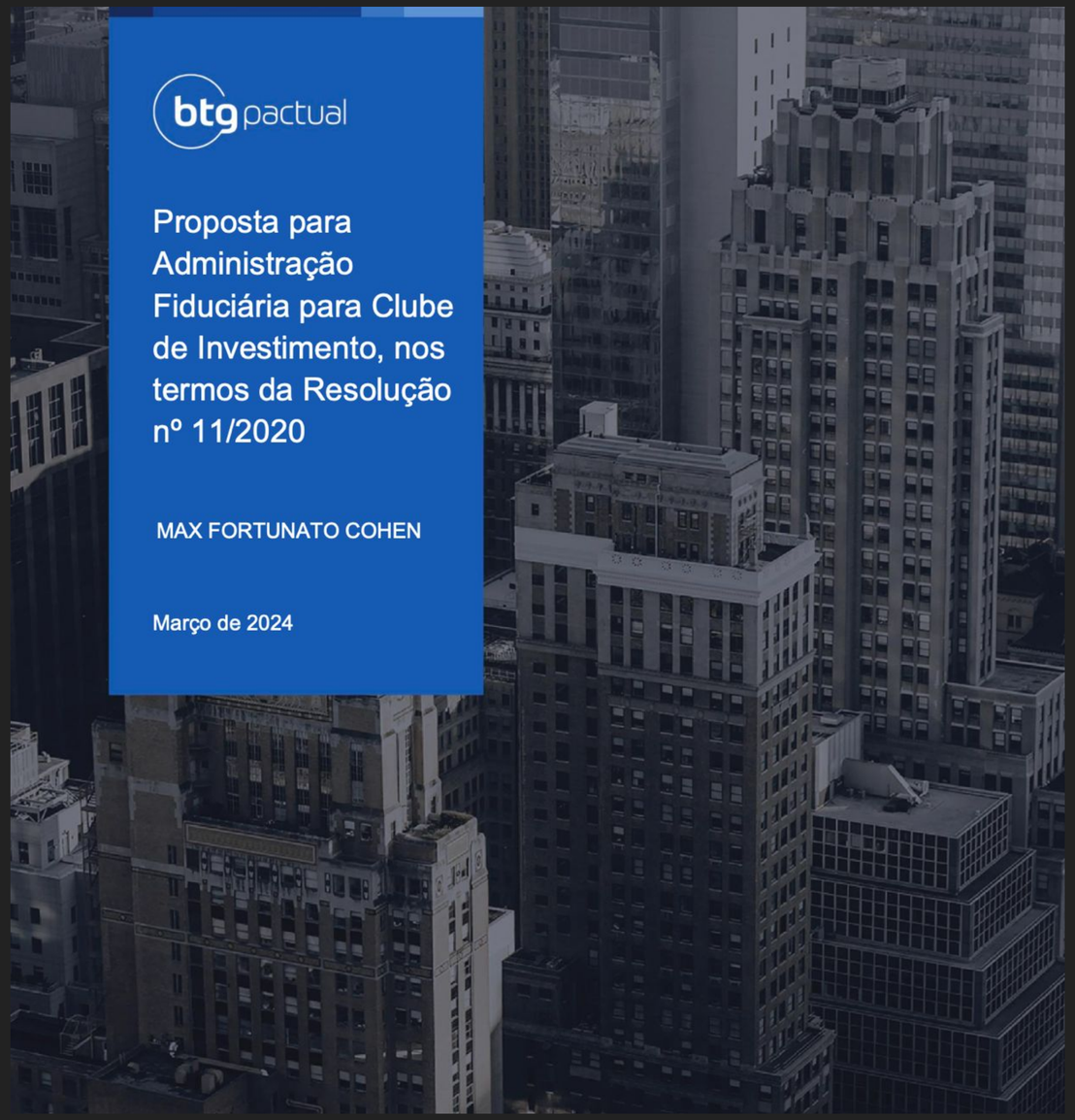
# ARAPAIMA

Arapaima

ARTIFICIAL INTELLIGENCE

# O CLUBE

- O Clube de Investimento é um condomínio aberto, constituído por no mínimo 3 (três) e no máximo 50 (cinquenta) pessoas naturais, para aplicação de recursos em títulos e valores mobiliários, conforme a Resolução CVM n.11/2020.
- Administração Fiduciária: Banco BTG.
- Assessoria de Investimento: EQI Corretora.
- Taxa de Administração: 0,6% a.a.
- Sem remuneração para o Gestor ou taxa de performance.
- 40% de desconto na taxa de corretagem.
- Gestão do portfólio: Gestor-Cotista, Max Cohen.
- Investimento a partir de R$50 mil.



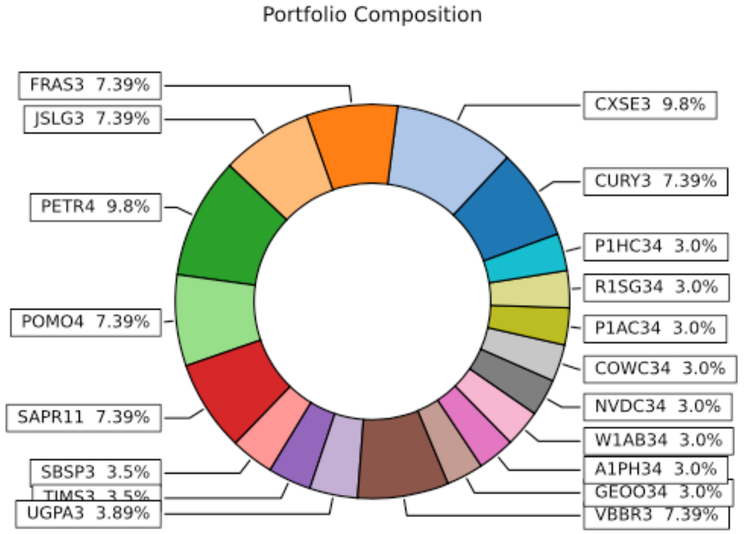
# A ESTRATÉGIA DE INVESTIMENTO

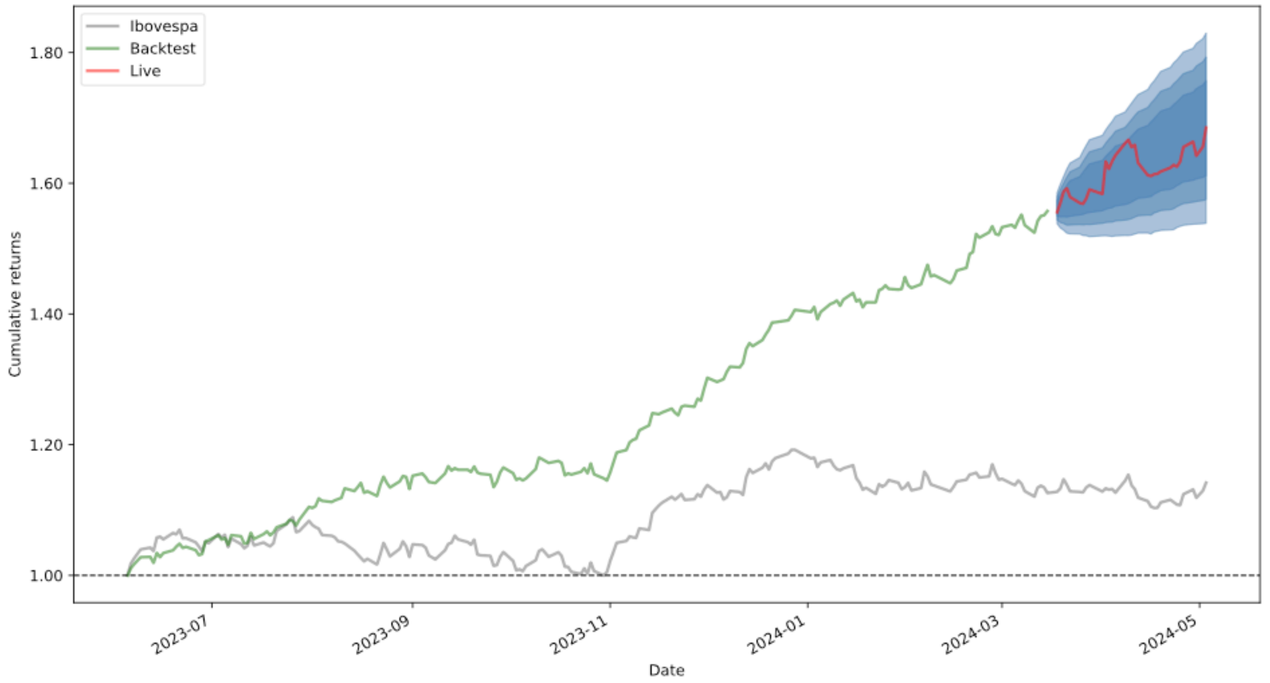
- O Arapaima Clube de Investimentos é o primeiro na Região Norte do Brasil a utilizar Factor Investing e Inteligência Artificial para apoio na criação do portfólio.
- QUANT INVESTING
  - Análise automatizada com apoio de inteligência artificial
  - Sem viés comportamental
  - Objetividade e praticidade
- FACTOR INVESTING
  - Mercado, Momentum, Tamanho, Valor, Qualidade
- Investimento no Brasil em portfólio de renda variável
- Rebalanceamento mensal (dia 01) e resgate em D+32

# PORTFÓLIOS VENCEDORES

| | |
|---|---|
| **Start date** | 2023-06-05 |
| **End date** | 2024-05-03 |
| **In-sample months** | 9 |
| **Out-of-sample months** | 1 |

| | In-sample | Out-of-sample | All |
|---|---|---|---|
| **Annual return** | 77.267% | 82.491% | 78.014% |
| **Cumulative returns** | 55.737% | 8.196% | 68.5% |
| **Annual volatility** | 12.143% | 14.766% | 12.52% |
| **Sharpe ratio** | 4.78 | 4.15 | 4.67 |
| **Calmar ratio** | 25.94 | 24.87 | 23.52 |
| **Stability** | 0.96 | 0.56 | 0.97 |
| **Max drawdown** | -2.979% | -3.317% | -3.317% |
| **Omega ratio** | 2.11 | 2.04 | 2.10 |
| **Sortino ratio** | 8.71 | 7.86 | 8.56 |
| **Skew** | 0.02 | 0.56 | 0.15 |
| **Kurtosis** | -0.08 | 1.52 | 0.42 |
| **Tail ratio** | 1.61 | 1.25 | 1.47 |
| **Daily value at risk** | -1.3% | -1.617% | -1.345% |
| **Alpha** | 0.60 | 0.68 | 0.61 |
| **Beta** | 0.66 | 0.84 | 0.68 |



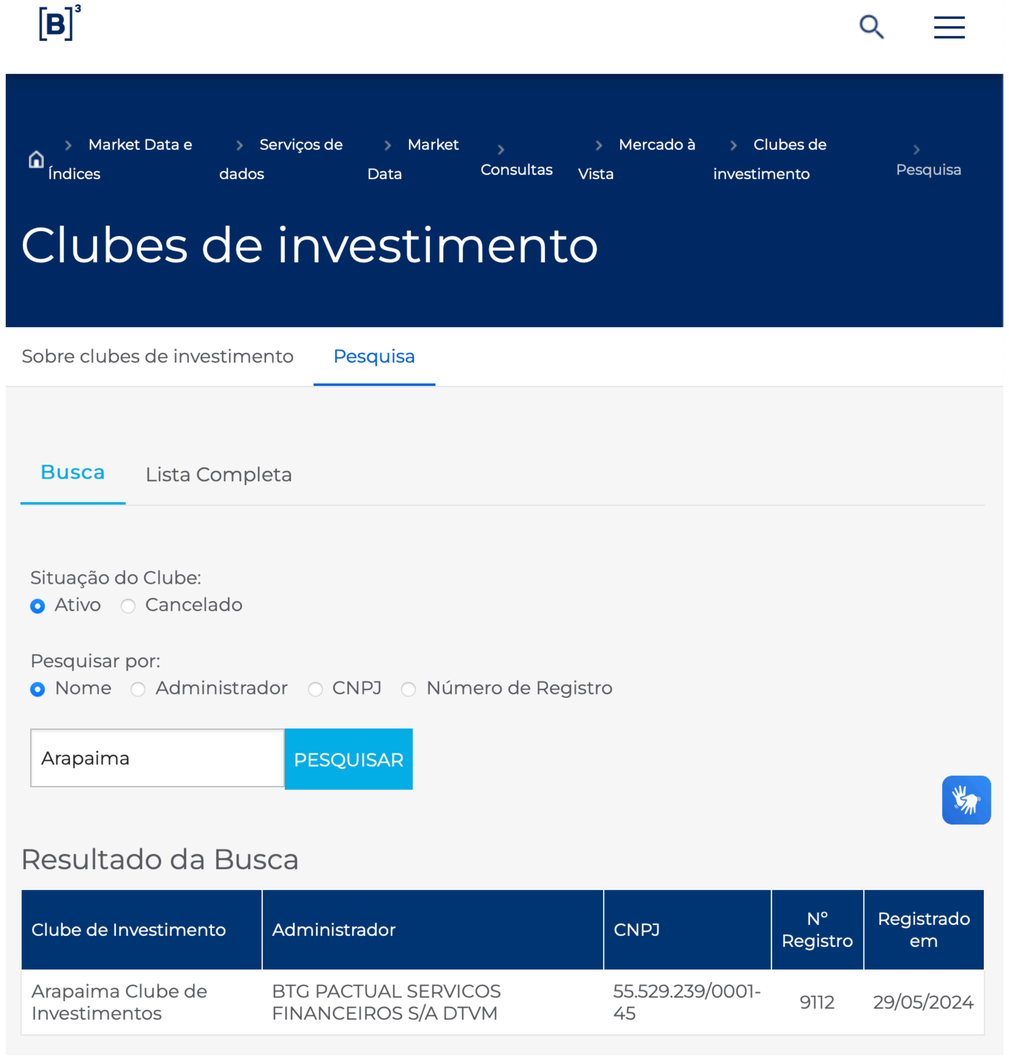



# AMBIENTE DE INTERAÇÃO E INFORMAÇÕES

- Acompanhamento do track record via app e site da EQI.
- Grupo de WhatsApp com
  - Compartilhamento da estratégia de Factor Investing e IA.
  - Compartilhamento do portfólio principal do Clube (com investimento no Brasil).
  - Compartilhamento de portfólios para vários outros mercados.
  - Discussão de assuntos pertinentes à área, incluindo Finanças Quantitativas (QUANT), Factor Investing e inteligência artificial.
- Reunião presencial periódica.
- LinkedIn: https://www.linkedin.com/company/arapaima-clube-de-investimentos/

# CADASTRO NA B3 – A BOLSA DE VALORES DO BRASIL

- Arapaima Clube de Investimentos
- BTG PACTUAL
- Registro nº9.112
- CNPJ 55.529.239/0001-45



# CONTATO

- EQI em Manaus
  - Victor Nunes
  - (92) 99205-2710

- Gestor do Portfólio
  - Max Cohen
  - (92) 98244-2123

# MAX COHEN

- O Gestor do Clube é Pesquisador Quantitativo de Ativos e Portfólios na Arapaima Inteligência Artificial. Economista. Cientista de Dados no Hospital Israelita Albert Einstein. Doutor em Administração de Empresas pela Escola de Administração de Empresas de São Paulo da Fundação Getulio Vargas (EAESP-FGV-SP). Mestre em Administração pela Universidade Federal de Santa Catarina (UFSC). Bacharel em Ciências Econômicas pela Universidade Federal do Amazonas (UFAM). Especialista em Inteligência Artificial Aplicada a Trading (UDACITY). Especialista em Gestão de Investimentos com Aprendizado de Máquina (EDHEC). MBA em Mercado Financeiro e de Capitais (FAAP/ Empiricus).