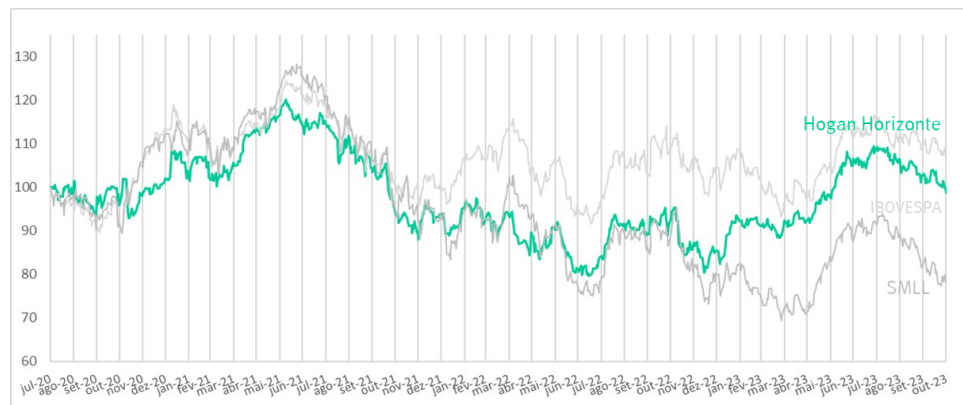


# Hogan Horizonte 130/30 FIM - Alpha Ampliado

Outubro 2023

01/03

## Retorno Acumulado



	Mês	Ano	1 ano	2 anos	3 anos	Início
Performance (%)	-4.6%	15.4%	4.2%	5.2%	2.7%	-1.6%
Ibovespa (%)	-2.9%	3.1%	-2.5%	9.3%	20.4%	9.9%
SMLL (%)	-7.4%	-2.7%	-16.2%	-16.2%	-13.2%	-20.7%
MSCI Latam (%)	-4.7%	-1.7%	-5.3%	-7.1%	6.1%	2.3%
CDI (%)	1.0%	11.0%	13.4%	26.5%	30.7%	31.3%

Fonte: Hogan / Bloomberg

Métricas de Exposição	Horizonte	Média	Intervalo	Limite	
		12m	12m	Min	Máx
Exposições (#)	42	40	31 / 48		
Longs (#)	26	27	20 / 33		
Shorts (#)	16	13	10 / 17		
Top 10 Ações (%PL)	68.5%	67.8%	63% / 74%		
Maior Long (%PL)	8.8%	10.0%	08% / 12%		20%
Maior Short (%PL)	-2.5%	-3.1%	-4% / -3%		20%
Exposição Líquida (%PL)	99.4%	93.3%	90% / 99%	90%	100%
Exposição Bruta (%PL)	152.0%	143.4%	127% / 155%	90%	160%
Exposição Bruta Brasil (%Total Bruto)	91.1%	87.8%	84% / 91%		

Fonte: Hogan

## Métricas de Risco

Volatilidade	17.5%
Volatilidade do Ibovespa	20.1%
Volatilidade do SMLL	21.9%
Beta/Ibovespa	0.8
Tracking error Ibovespa	6.8%
Tracking error SMLL	13.9%

\*Fonte: Hogan / \*Projetado pelo modelo multifatorial da Bloomberg

[www.hoganinvest.com.br](http://www.hoganinvest.com.br)

## Informações sobre o Fundo

### OBJETIVO

Busca a apreciação do capital e obtenção de retorno superior ao mercado de ações.

### PÚBLICO ALVO

Investidores em geral.

### CLASSIFICAÇÃO ANBIMA

Multimercado

### TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

1.5% a.a

### TAXA DE PERFORMANCE

20% sobre a rentabilidade que exceder a variação do IBOVESPA.

### MOVIMENTAÇÃO

Inicial	R\$ 5.000
Movimentação Mínima	R\$ 1.000
Saldo Mínimo	R\$ 5.000

### APLICAÇÕES

Horário limite	18h00
Conversão da cota <sup>1</sup>	D+1

### RESGATES

Horário limite	18h00
Conversão da cota <sup>2</sup>	D+30
Liquidação <sup>2</sup>	D+32

### Dados Bancários

BNY Mellon Banco SA (017)  
AG: 0001  
CC: 5767-3

### CÓDIGOS

ANBIMA	545661
Bloomberg	HOGAHRZ
ISIN	BR04118CT007

### IMPOSTO DE RENDA

15% sobre o ganho nominal, calculado e recolhido no resgate.

### Patrimônio

Fundo: R\$ 1,4mi  
Média: 12m - R\$ 1,48mi

[www.hoganinvest.com.br](http://www.hoganinvest.com.br)

<sup>1</sup> Contado a partir da efetiva disponibilidade dos recursos.

<sup>2</sup> São utilizados dias corridos na contagem do prazo de cotização e a diferença entre o prazo para pagamento e cotização leva em conta apenas dias úteis.



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

## Hogan Horizonte 130/30 FIM Alpha Ampliado

Outubro 2023

02/03

Exposição Geográfica (%PL)	Horizonte	BRA	Outros
Exposição Líquida (%PL)	99.4%	88.2%	11.2%
Exposição Long (%PL)	125.7%	113.4%	12.3%
Exposição Short (%PL)	-26.3%	-25.2%	-1.1%
Exposição Bruta (%PL)	152.0%	138.5%	13.4%
Longs (#)	26	23	3
Shorts (#)	16	15	1

Fonte: Hogan

Exposição Setorial (%PL)	Horizonte	BRA	Outros
Commodities	18.3%	18.3%	0.0%
Financial Institutions	17.4%	17.4%	0.0%
Utilities	13.4%	13.4%	0.0%
Consumer	13.2%	8.8%	4.4%
Real Estate & Properties	11.6%	11.6%	0.0%
Industrial & Capital Goods	9.9%	9.9%	0.0%
Infrastructure & Logistics	6.8%	6.8%	0.0%
Retail	3.9%	-0.4%	4.3%
Consumer Staples	3.5%	-0.1%	3.6%
Telecom, Media & Technology	1.3%	2.5%	-1.1%

Fonte: Hogan

Exposição por Fator de Estilo (%PL)	Horizonte	BRA	Outros
Cheapness	96.1%	85.1%	11.0%
High Yield	52.3%	46.4%	5.8%
Value	50.7%	40.1%	10.6%
High Leverage	34.1%	32.0%	2.1%
Fundamental Momentum	27.4%	26.4%	0.9%
Growth	15.4%	13.3%	2.1%
Lower Size	11.6%	11.6%	0.0%
FX Protection	6.1%	-5.6%	11.7%
Lower Liquidity	1.1%	1.1%	0.0%
Indicators of Change - Events/ESG	-80.2%	-80.4%	0.3%

Fonte: VMQ

Maiores Exposições	Setor	Exposição
BANCO DO BRASIL	Financial	8.8%
EQUATORIAL E-ORD	Utilities	8.4%
MARCOPOLO-PREF	Industrial	7.8%
PETROBRAS-PREF	Commodities	7.1%
HAPVIDA PARTICIP	Consumer	6.6%

Fonte: Hogan

## Hogan Horizonte 130/30 FIM Alpha Ampliado

Outubro 2023

03/03

	Performance por mês/ano												
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2020								-1.6%	-4.6%	2.1%	2.4%	3.9%	2.2%
2021	-0.4%	0.1%	3.9%	7.5%	3.4%	-2.5%	0.0%	-4.3%	-5.1%	-9.6%	-5.9%	6.8%	-7.9%
2022	2.7%	-2.6%	-0.9%	-5.1%	2.1%	-10.7%	4.5%	7.2%	-0.9%	5.7%	-7.6%	-2.3%	-9.2%
2023	8.2%	-1.2%	0.6%	1.4%	4.9%	8.2%	3.6%	-5.5%	-0.2%	-4.6%			15.4%

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo de investimento ao aplicar os seus recursos. Fundos de Investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Não obstante a diligência do gestor em selecionar as melhores opções de investimento, a carteira do fundo está, por sua própria natureza sujeita as flutuações de preços/cotações de seus ativos, além de riscos de crédito e liquidez o que pode acarretar perda patrimonial do fundo. Para avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os fundos de ações com renda variável podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Este material tem o único propósito de divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela Hogan Investimentos, não deve ser considerado como oferta de venda de cotas de fundos de investimento ou de qualquer título ou valor mobiliário e não constitui o prospecto previsto nas normas advindas da CVM ou no Código de Auto Regulação da ANBIMA. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. 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 quotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado, implicando na ocorrência de patrimônio líquido do Fundo e a consequente obrigação do quotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do Fundo.