

SOBRE A ALPHA WAVE CAPITAL

A Alpha Wave Capital é uma gestora independente especializada em estratégias quantitativas e operações estruturadas.

Nosso foco é a exploração disciplinada de assimetrias estatísticas entre volatilidade implícita e realizada, combinando modelos probabilísticos, gestão rigorosa de risco e diversificação entre mercados Brasil e EUA.

ESTRATÉGIA

O fundo identifica e captura distorções entre volatilidade implícita operando estruturas em opções com perfil defined-risk e entrada/saída disciplinada por regras quantitativas.

- Filtros de IV Rank e Z-Score de volatilidade implícita
- Análise de estrutura a termo e Kurtosis de IV
- Diversificação de mercados Brasil/EUA com controle de correlação
- Monitoramento contínuo de VaR, CVaR e stress testing multi-cenário

CONTATO

✉ atendimento@alphawavecapital.com.br

☎ (51) 2914-8000

📍 Avenida Melvin Jones, 2222 Sala 05 Santa Cruz do Sul - RS 96823-000

🌐 <https://www.alphawavecapital.com.br/>

CARACTERÍSTICAS

GESTÃO: ALPHA WAVE CAPITAL LTDA

CNPJ: 55.779.544/0001-95

ADMINISTRADOR: BANCO DAYCOVAL S.A.

CUSTODIANTE: BANCO DAYCOVAL S.A.

AUDITORIA: PWC

TX DE ADMINISTRAÇÃO: 2% a.a.

TX DE PERFORMANCE: 20% sobre o que exceder o CDI

ÍNDICE DE PERFORMANCE: CDI

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA: Multimercado Livre

INFORMAÇÃO OPERACIONAIS

APLICAÇÃO MÍNIMA: R\$1.000,00

MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA: R\$1.000,00

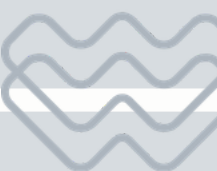
SALDO MÍNIMO: R\$1.000,00

DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS APLICADOS: D+0

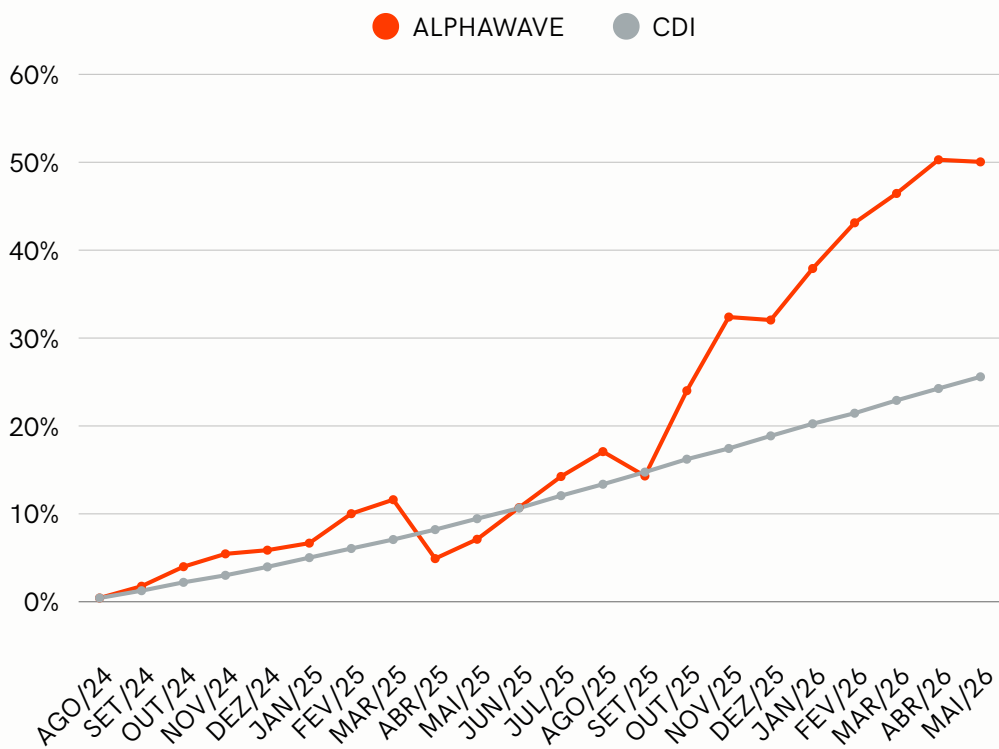
CONVERSÃO DA COTA PARA APLICAÇÃO: D+0

CONVERSÃO DA COTA PARA RESGATE: D+20

DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS RESGATADOS: D+21



ALPHA WAVE 300 FIM x CDI



HISTÓRICO

PL MÉDIO ÚLTIMOS 12 MESES: R\$ 5.61 MM

INÍCIO DO FUNDO: 15/08/2024

MÁXIMO RETORNO MENSAL: 8,49% (OUTUBRO/2025)

MÍNIMO RETORNO MENSAL: -6,00% (ABRIL/2025)

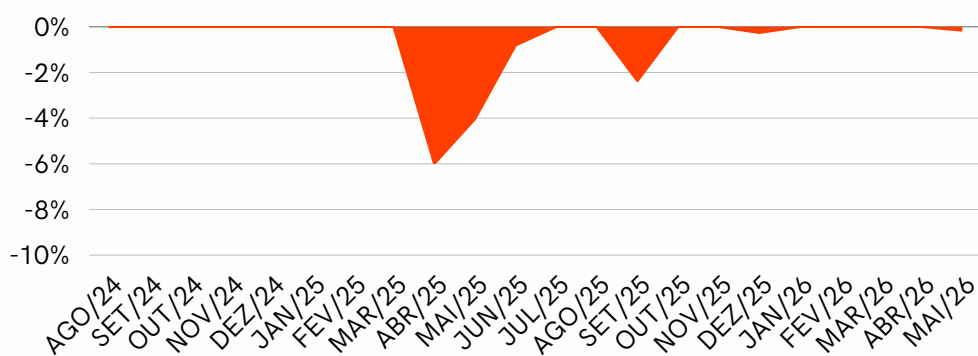
NÚMERO DE MESES COM RETORNO POSITIVO: 18

NÚMERO DE MESES COM RETORNO NEGATIVO: 4

RETORNO ACUMULADO DESDE O INÍCIO: 50,04%

VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO: 10,13%

DRAWDOWN



ÍNDICE DE RENTABILIDADE

MÉTRICA/PERÍODO	1 MÊS	3 MESES	12 MESES	TOTAL
RENTABILIDADE	-0,16%	4,84%	40,09%	50,04%
VOLATILIDADE	0,16%	5,29%	10,30%	10,13%
ÍNDICE DE SHARPE	-1,43	1,10	2,02	1,03

PERFORMANCE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEV	ANO	ACUM
2026	4,44%	3,77%	2,33%	2,62%	-0,16%								13,63%	50,04%
% CDI	381,12%	378,52%	191,73%	239,86%	-14,98%	-	-	-	-	-	-	-	267,84%	195,53%
2025	0,75%	3,14%	1,45%	-6,00%	2,09%	3,36%	3,20%	2,48%	-2,37%	8,49%	6,76%	-0,26%	24,74%	32,05%
% CDI	74,26%	318,74%	151,09%	-568,02%	183,88%	306,65%	251,12%	212,71%	-193,87%	665,69%	642,27%	-21,49%	172,85%	170,00%
2024								0,43%	1,33%	2,19%	1,40%	0,40%	5,86%	5,86%
% CDI	-	-	-	-	-	-	-	98,89%	160,00%	235,47%	136,75%	42,64%	147,43%	147,43%