

Estratégia de Investimento

O CORE aloca seus recursos primordialmente em cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios selecionados através de processos de análise/monitoramento robustos, criados a partir da experiência da equipe de Análise de Crédito Privado da Solis Investimentos. O processo de alocação é constituído por três pilares: identificação do ativo (análise do originador/consultora, da estruturação do fundo e do seu regulamento); construção do portfólio com base no binômio retorno e liquidez; e o monitoramento das carteiras, que visa resguardar e antecipar situações que possam trazer eventuais riscos ao portfólio.

Objetivo

O fundo tem por objetivo proporcionar rentabilidade superior à verificada pelo CDI, calculado pela CETIP, no médio e longo prazo, por meio do investimento em cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios.

Público Alvo

Investidores qualificados que procuram retornos superiores ao CDI no médio e longo prazo.

Rentabilidade Histórica

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Ano	Início
2019	Fundo (%)	0,71%	0,66%	0,62%	0,68%	0,70%	0,60%	0,71%	0,63%	0,58%	0,67%			6,75%	150,99%
	% CDI	130,53%	132,71%	133,09%	131,27%	129,11%	127,08%	125,17%	124,55%	125,65%	139,74%			130,60%	149,45%
2018	Fundo (%)	0,78%	0,64%	0,72%	0,71%	0,70%	0,71%	0,74%	0,76%	0,61%	0,68%	0,62%	0,62%	8,62%	135,11%
	% CDI	134,54%	136,67%	134,82%	137,74%	136,12%	136,76%	136,06%	134,54%	130,24%	126,11%	125,50%	126,18%	134,27%	148,27%
2017	Fundo (%)	1,36%	1,09%	1,30%	1,00%	1,19%	1,06%	1,02%	1,01%	0,84%	0,85%	0,76%	0,73%	12,92%	116,45%
	% CDI	125,35%	125,62%	124,22%	127,47%	128,91%	130,82%	127,79%	126,61%	131,51%	131,55%	134,18%	136,10%	130,14%	146,30%
2016	Fundo (%)	1,31%	1,31%	1,44%	1,33%	1,62%	1,22%	1,35%	1,50%	1,36%	1,34%	1,40%	1,40%	17,77%	91,69%
	% CDI	124,62%	130,61%	123,92%	125,92%	146,50%	104,98%	122,29%	123,61%	123,06%	127,48%	123,62%	125,17%	126,93%	144,67%
2015	Fundo (%)	1,27%	1,13%	1,47%	1,24%	1,24%	1,38%	1,41%	1,30%	1,33%	1,37%	1,39%	1,45%	17,19%	62,77%
	% CDI	136,78%	137,76%	141,83%	130,92%	125,96%	129,09%	119,61%	117,48%	119,71%	124,02%	131,36%	125,12%	129,88%	144,91%
2014	Fundo (%)	1,12%	1,04%	1,05%	0,82%	1,11%	1,04%	1,17%	1,05%	1,17%	1,24%	1,09%	1,29%	13,99%	38,89%
	% CDI	133,38%	132,77%	137,69%	100,42%	128,99%	126,80%	124,00%	121,93%	129,38%	131,76%	129,65%	134,86%	129,38%	146,41%
2013	Fundo (%)	1,78%	0,61%	1,01%	0,89%	0,83%	0,81%	0,85%	0,03%	0,88%	1,60%	0,98%	1,07%	11,96%	21,84%
	% CDI	304,17%	126,09%	187,80%	148,94%	141,75%	137,31%	119,54%	3,91%	126,44%	199,72%	138,24%	137,59%	148,25%	153,70%
2012	Fundo (%)					0,70%	1,36%	0,76%	0,93%	1,01%	0,88%	1,00%	0,99%	8,83%	8,83%
	% CDI					118,85%	185,38%	119,53%	138,40%	147,83%	163,57%	164,74%	158,69%	184,39%	155,27%

Rentabilidade por Período

12 meses	8,08%
24 meses	17,69%
36 meses	34,47%
Início	150,99%

Patrimônio do Fundo

PL Atual	R\$ 1.079.251.421,29
PL Médio 12 meses	R\$ 832.248.780,27

Perfil de Retorno

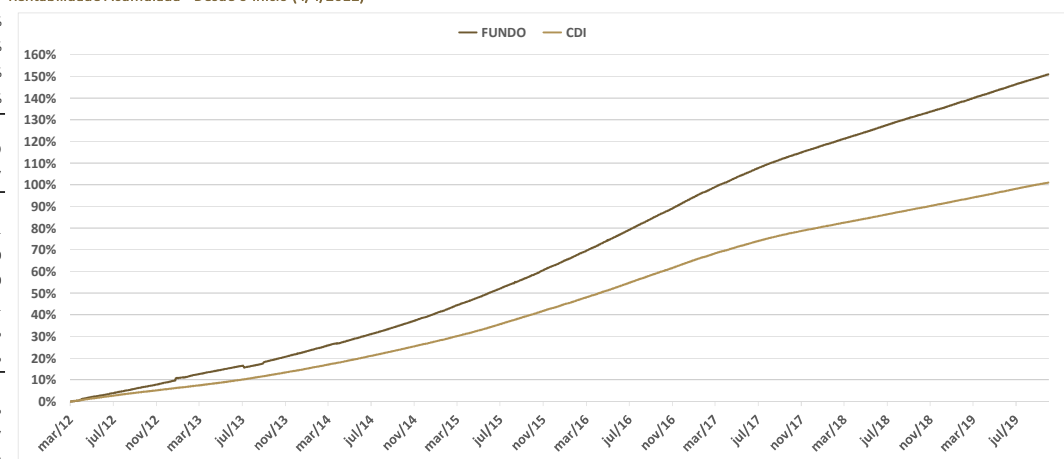
N° de Meses Positivos - desde o início	91
N° de Meses Negativos - desde o início	0
Meses acima do CDI - desde o início	90
Meses abaixo do CDI - desde o início	1
Maior retorno em um mês	1,78%
Menor retorno em um mês	0,03%

Perfil de Risco

Volatilidade ¹ - 12 meses	0,04%
Sharpe - 12 meses	61,47
Sharpe - 36 meses	58,99
Var 1 mês - 95%	0,02%
Var 12 meses - 95%	0,06%

¹ Volatilidade é uma medida que informa a oscilação dos retornos de forma anualizada

Rentabilidade Acumulada - Desde o Início (4/4/2012)



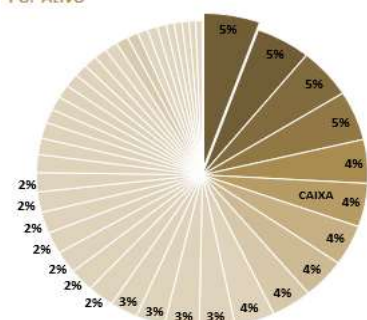
Classificação de Risco do Fundo²



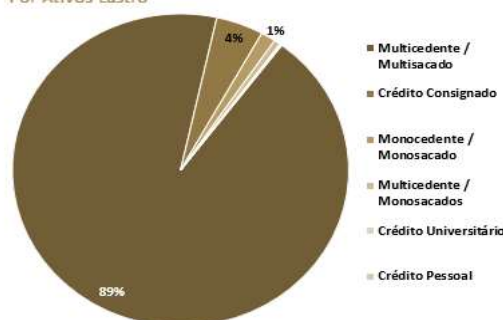
² critério qualitativo que leva em consideração prazo, riscos e estratégias das carteiras

Composição do Carteira

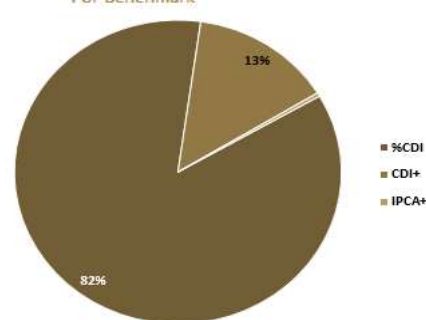
Por Ativo



Por Ativos Lastro



Por Benchmark



Características

CNPJ: 13.054.656/0001-39	Cód. Anbima: 300251	Cota de Aplicação: D+0
Início do Fundo: 04/04/2012	Class. Anbima: Multimercados Livre	Cota de Resgate: D+58
Gestão: Solis Investimentos	Tipo de Investidor: Qualificado	Liquidação do Resgate: D+59
Administração: BTG Pactual Serviços Financeiros	Classificação CVM: Multimercados	Tx. de administração: 0,4%
Custódia: Banco BTG Pactual	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000	Tx. de perf.: não há
Auditor: Ernst & Young Auditores	Movimentação Mínima: Não há limite	Tributação: Longo Prazo - Tabela Regressiva
Distribuidor: Solis Investimentos	Horário Limite de movimentação: 14:00	Período de Carência: não há

Contatos

SOLIS Investimentos Ltda.
Rua Ferreira de Araújo, 221, 11º Andar, São Paulo - SP, 05428-000
Fone: (11) 3031-7370
investimentos@solisinvestimentos.com.br
www.solisinvestimentos.com.br

BTG PACTUAL Serviços Financeiros S.A DTVM
Praia de Botafogo, 501, 5º andar, Rio de Janeiro - RJ, 22250-911
Fone: (21) 3262-8870
OL-Eventos-PSF@btgpactual.com
www.btgpactual.com.br