

**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.

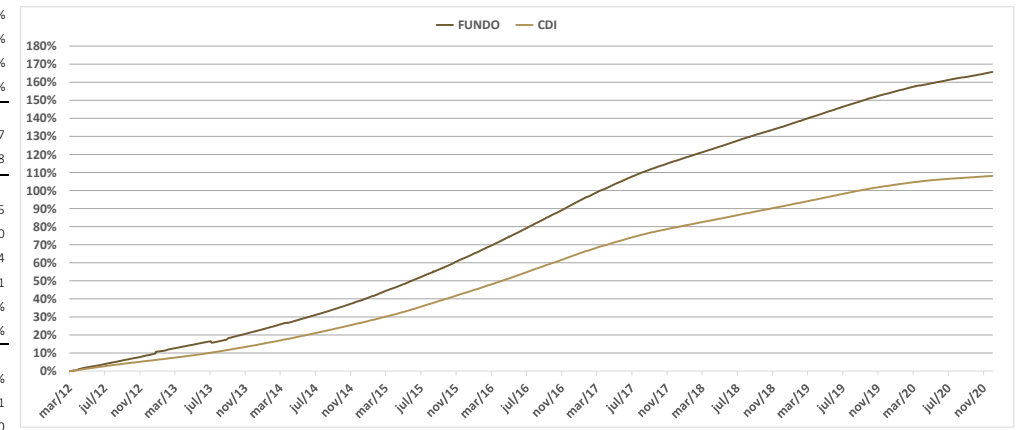
**Rentabilidade Histórica**

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Ano	Início
2020	Fundo (%)	0,54%	0,43%	0,52%	0,35%	0,37%	0,35%	0,40%	0,34%	0,28%	0,34%	0,32%	0,40%	4,76%	165,69%
	% CDI	144,27%	146,58%	154,66%	124,27%	154,47%	164,08%	206,90%	214,34%	175,22%	218,32%	217,19%	241,25%	171,97%	153,19%
2019	Fundo (%)	0,71%	0,66%	0,62%	0,68%	0,70%	0,60%	0,71%	0,63%	0,58%	0,67%	0,52%	0,53%	7,87%	153,62%
	% CDI	130,53%	132,71%	133,09%	131,27%	129,11%	127,08%	125,17%	125,02%	125,65%	139,74%	135,90%	141,04%	131,89%	149,79%
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%	1,28%	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%	0,86%	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%	155,27%

**Rentabilidade por Período**

12 meses	4,74%
24 meses	12,99%
36 meses	22,73%
Início	165,69%

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



**Patrimônio do Fundo**

PL Atual	R\$ 791.729.251,87
PL Médio 12 meses	R\$ 904.202.167,88

**Perfil de Retorno**

Nº de Meses Positivos - desde o início	105
Nº de Meses Negativos - desde o início	0
Meses acima do CDI - desde o início	104
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 <sup>1</sup> - 12 meses	0,09%
Sharpe - 12 meses	24,91
Sharpe - 36 meses	37,80
VaR 1 mês - 95%	0,04%
VaR 12 meses - 95%	0,15%

**Classificação de Risco do Fundo<sup>2</sup>**

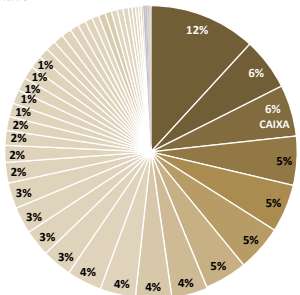


<sup>1</sup> Volatilidade é uma medida que informa a oscilação dos retornos de forma anualizada

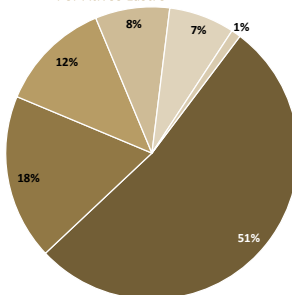
<sup>2</sup> critério qualitativo que leva em consideração prazo, riscos e estratégias das carteiras

**Composição do Carteira**

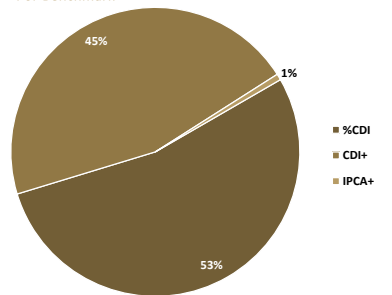
**Por Ativo**



**Por Ativos Lastro**



**Por Benchmark**



**Características**

CNPJ:	13.054.656/0001-39
Início do Fundo:	04/04/2012
Gestão:	Solis Investimentos
Administração:	BTG Pactual Serviços Financeiros
Custódia:	Banco BTG Pactual
Auditor:	Ernst & Young Auditores
Distribuidor:	Solis Investimentos

Cód. Anbima:	300251
Class. Anbima:	Multimercados Livre
Tipo de Investidor:	Qualificado
Classificação CVM:	Multimercados
Aplicação Mínima:	R\$ 1.000.000
Movimentação Mínima:	Não há limite
Horário Limite de movimentação:	14:00

Cota de Aplicação:	D+0
Cota de Resgate:	D+58
Liquidação do Resgate:	D+59
Tx. de administração:	0,4%
Tx. de perf.:	não há
Tributação:	Longo Prazo - Tabela Regressiva
Período de Carência:	não há

**Contatos**

**SOLIS Investimentos Ltda.**  
Rua Ferreira de Araújo, 202, 9º 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

Este relatório foi elaborado pela Solis Investimentos LTDA, ("Solis"), sob sua responsabilidade e tem caráter meramente informativo, não podendo ser distribuído, reproduzido ou copiado sem a sua expressa concordância. A Solis não se responsabiliza por erros de avaliação ou omissões. Os Investidores têm que tomar suas próprias decisões de investimento. Este relatório é um informativo e destinado aos cotistas do fundo, não representando oferta ou publicidade. Verifique a tributação aplicável. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. Fundos de investimento não são garantidos pelo administrador do fundo, gestor do fundo, por qualquer mecanismo de seguro, ou ainda, pelo fundo garantidor de crédito (FGC). Ao Investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e o regulamento do fundo de investimento antes de qualquer decisão de investimento.

