

## Estratégia de Investimento

O SOLIS 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  |
|------|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 2025 | Fundo (%) | 1,22%   | 1,20%   | 1,18%   | 1,36%   |         |         |         |         |         |         |         |         | 5,06%   | 364,72% |
|      | % CDI     | 120,95% | 121,56% | 123,07% | 129,17% |         |         |         |         |         |         |         |         | 124,21% | 166,89% |
| 2024 | Fundo (%) | 1,25%   | 1,06%   | 1,11%   | 1,19%   | 1,07%   | 1,05%   | 1,18%   | 2,00%   | 1,35%   | 1,17%   | 0,99%   | 1,00%   | 15,42%  | 342,35% |
|      | % CDI     | 129,41% | 132,11% | 133,71% | 134,04% | 128,81% | 132,57% | 130,54% | 231,10% | 162,41% | 126,48% | 124,56% | 107,41% | 141,82% | 166,12% |
| 2023 | Fundo (%) | 1,37%   | 1,01%   | 1,30%   | 1,01%   | 1,39%   | 1,31%   | 1,29%   | 1,38%   | 1,20%   | 0,72%   | 1,17%   | 1,44%   | 15,60%  | 283,24% |
|      | % CDI     | 121,67% | 110,16% | 110,67% | 110,16% | 123,39% | 121,78% | 120,04% | 121,46% | 122,95% | 71,92%  | 127,87% | 160,95% | 119,53% | 160,88% |
| 2022 | Fundo (%) | 1,05%   | 1,02%   | 1,19%   | 1,07%   | 1,30%   | 1,25%   | 1,26%   | 1,41%   | 1,28%   | 1,24%   | 1,27%   | 1,39%   | 15,78%  | 231,54% |
|      | % CDI     | 143,82% | 135,58% | 129,34% | 128,21% | 126,33% | 123,55% | 121,42% | 120,98% | 119,03% | 121,74% | 124,39% | 124,03% | 127,50% | 160,57% |
| 2021 | Fundo (%) | 0,34%   | 0,31%   | 0,45%   | 0,43%   | 0,52%   | 0,59%   | 0,64%   | 0,73%   | 0,72%   | 0,79%   | 0,89%   | 1,10%   | 7,78%   | 186,36% |
|      | % CDI     | 229,72% | 228,48% | 228,78% | 209,05% | 193,78% | 193,06% | 181,05% | 172,30% | 163,70% | 164,76% | 151,08% | 144,61% | 177,04% | 158,86% |
| 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%   |         |
|      | % 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  
24 meses  
36 meses  
Início

## Patrimônio do Fundo

|                              |                       |
|------------------------------|-----------------------|
| PL Atual                     | R\$ 2.867.743.465,13  |
| PL Médio 12 meses            | R\$ 2.595.726.483,20  |
| PL Atual Estratégia          | R\$ 10.165.475.464,18 |
| PL Médio 12 meses Estratégia | R\$ 8.641.569.550,35  |

## Perfil de Retorno

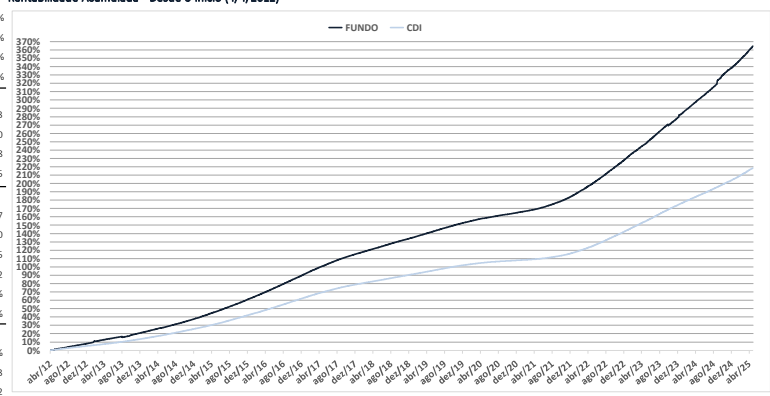
|                                        |       |
|----------------------------------------|-------|
| Nº de Meses Positivos - desde o início | 157   |
| Nº de Meses Negativos - desde o início | 0     |
| Meses acima do CDI - desde o início    | 155   |
| Meses abaixo do CDI - desde o início   | 2     |
| Maior retorno em um mês                | 2,00% |
| Menor retorno em um mês                | 0,03% |

## Perfil de Risco

|                                      |       |
|--------------------------------------|-------|
| Volatilidade <sup>1</sup> - 12 meses | 0,90% |
| Sharpe - 12 meses                    | 4,33  |
| Sharpe - 36 meses                    | 4,62  |
| VaR 1 mês - 95%                      | 0,43% |
| VaR 12 meses - 95%                   | 1,49% |

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

## Rentabilidade Acumulada - Desde o início (4/4/2012)

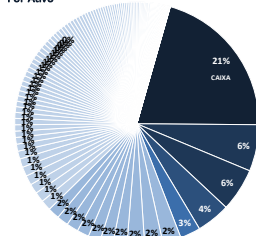
Classificação de Risco do Fundo<sup>2</sup>

INVESTIMENTO MENOS ARRISCADO 1 2 3 4 5 INVESTIMENTO MAIS ARRISCADO

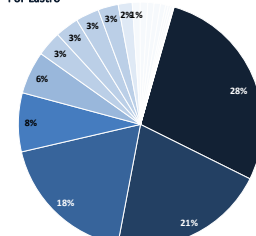
<sup>2</sup> Critério qualitativo que leva em consideração prazo, riscos e estratégias das carteiras

## Composição do Carteira

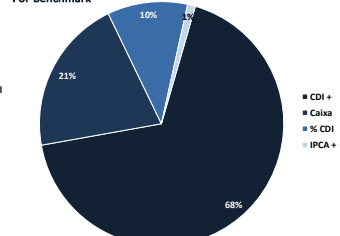
## Por Ativo



## Por 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:         | PwC Auditores Independentes      |
| Distribuidor:    | BTG                              |

|                                 |                                     |
|---------------------------------|-------------------------------------|
| Cód. Anbima:                    | 300251                              |
| Class. Anbima:                  | Multimercados Estratégia Específica |
| 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. Global de Remuneração: | 0,4%                            |
| Tx. de perf.:              | não há                          |
| Tributação:                | Longo Prazo - Tabela Regressiva |
| Período de Carência:       | não há                          |

**Contatos**  
**SOLIS Investimentos Ltda.**  
Avenida Pedroso de Moraes, 1553, 4º Andar, São Paulo - SP, 05419-001  
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 emissões. 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 situação 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.