SOLIS VERTENTE FIRF REF DI

SOLIS

maio-25

Estratégia de Investimento

O VERTENTE possui uma estratégia de investimento que busca associar a rentabilidade estável de títulos públicos com os prêmios dos ativos de crédito privado. A escolha dos ativos advém de processos de análise e monitoramento robustos, criados a partir da experiência da equipe de análise de mercado e crédito da Solis Investimentos. O processo de alocação é constituído por três pilares: identificação do ativo; 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 VERTENTE tem por objetivo proporcionar rentabilidade próxima à verificada pelo CDI, calculado pela CETIP, no curto, médio e longo prazo, por meio do investimento em ativos de renda fixa, admitindo-se estratégias com risco de juros e de índice de preços. O Fundo pode investir no máximo 30% da sua carteira em títulos de emissão de bancos.

Público Alvo

Investidores em geral.

Rentabilidade Histórica

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Ano	Início
2025	Fundo (%)	1,02%	0,97%	0,94%	1,03%	1,12%								5,19%	67,03%
	% CDI	101,09%	98,25%	97,76%	97,93%	98,84%								98,76%	96,74%
2024	Fundo (%)	0,97%	0,81%	0,83%	0,88%	0,82%	0,78%	0,89%	0,86%	0,83%	0,92%	0,78%	0,87%	10,73%	58,79%
	% CDI	99,84%	100,40%	99,65%	99,34%	97,88%	99,22%	98,39%	99,69%	99,83%	98,69%	99,16%	93,50%	98,70%	96,64%
2023	Fundo (%)	1,12%	0,91%	1,15%	0,88%	1,13%	1,08%	1,05%	1,13%	0,96%	0,97%	0,90%	0,90%	5,19%	43,40%
	% CDI	99,55%	99,58%	98,02%	96,22%	100,58%	100,39%	97,57%	99,50%	98,77%	97,09%	98,30%	100,35%	98,79%	96,31%
2022	Fundo (%)	0,75%	0,81%	0,93%	0,78%	1,05%	1,02%	1,02%	1,16%	1,07%	1,03%	1,03%	1,12%	12,43%	27,03%
	% CDI	102,40%	107,67%	100,63%	94,05%	101,40%	100,29%	98,94%	99,02%	100,26%	101,30%	100,73%	99,74%	100,42%	95,43%
2021	Fundo (%)	0,10%	0,08%	0,15%	0,15%	0,26%	0,31%	0,35%	0,41%	0,42%	0,51%	0,60%	0,76%	4,17%	12,99%
	% CDI	65,97%	57,02%	75,61%	71,18%	96,66%	100,13%	98,75%	97,39%	96,90%	106,52%	101,42%	99,52%	94,82%	91,52%
2020	Fundo (%)	0,35%	0,27%	0,31%	-0,05%	0,27%	0,24%	0,25%	0,08%	-0,12%	0,14%	0,11%	0,33%	2,20%	8,47%
	% CDI	91,97%	91,11%	91,91%	-18,26%	114,29%	110,68%	129,95%	51,84%	-75,57%	90,32%	73,06%	200,89%	79,61%	90,23%
2019	Fundo (%)	0,56%	0,48%	0,46%	0,51%	0,52%	0,45%	0,55%	0,49%	0,43%	0,48%	0,35%	0,30%	5,73%	6,13%
	% CDI	103,33%	97,42%	97,69%	97,62%	95,97%	96,21%	96,54%	97,70%	93,29%	99,47%	92,42%	81,24%	96,08%	95,32%
2018	Fundo (%)												0,38%	0,38%	0,38%
	% CDI												85,81%	85,81%	85,81%

Rentabilidade por Período

12 meses	11,64%
24 meses	24,93%
36 meses	41,68%
Início	67,03%

Patrimônio do Fundo

PL Atual	R$ 1.664.747.438,12
PL Médio 12 meses	R$ 1.194.762.431,80

Perfil de Retorno

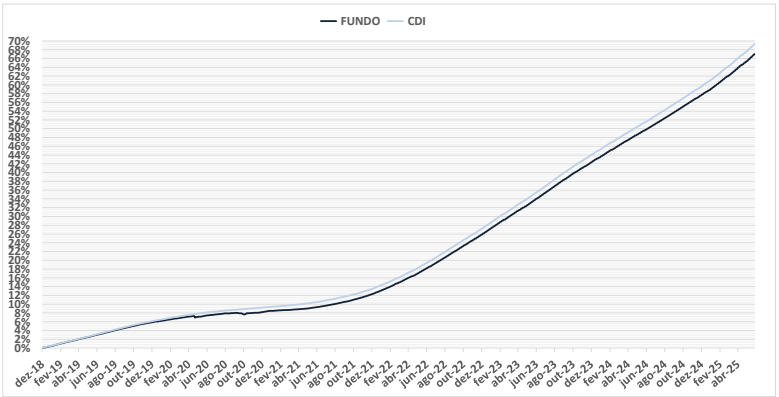
N° de Meses Positivos - desde o início	76
N° de Meses Negativos - desde o início	2
Meses acima do CDI - desde o início	20
Meses abaixo do CDI - desde o início	58
Maior retorno em um mês	1,16%
Menor retorno em um mês	-0,12%

Perfil de Risco

Volatilidade[1] - 3 meses	0,04%
Sharpe - 3 meses	-14,23
Sharpe - 12 meses	-4,82
VaR 1 mês - 95%	0,01%
VaR 12 meses - 95%	0,15%

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

Rentabilidade Acumulada - Desde o Início (4/12/2018)



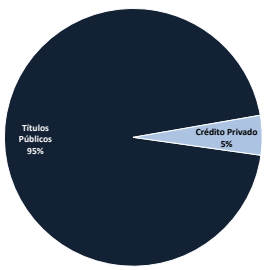
Classificação de Risco do Fundo[2]

INVESTIMENTO MENOS ARRISCADO	1	**2**	3	4	5	INVESTIMENTO MAIS ARRISCADO

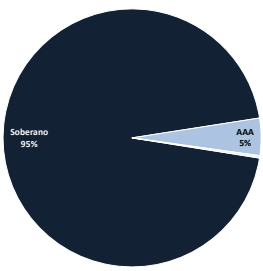
[2] critério qualitativo que leva em consideração prazo, riscos e estratégias das carteiras

Composição do Carteira

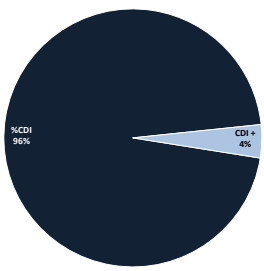
Por Ativo



Por Rating



Por Benchmark



Caracteristicas

CNPJ:	30.630.384/0001-97	**Cód. Anbima:**	483427	**Cota de Aplicação:**	D+0
Início do Fundo:	04/12/2018	**Class. Anbima:**	Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	**Cota de Resgate:**	D+0
Gestão:	Solis Investimentos	**Tipo de Investidor:**	Público em Geral	**Liquidação do Resgate:**	D+0
Administração:	BTG Pactual Serviços Financeiros	**Classificação CVM:**	Renda Fixa	**Tx. Global de Remuneração:**	0,25%
Custódia:	Banco BTG Pactual	**Aplicação Minima:**	1.000	**Tx. de perf.:**	não há
Auditor:	PwC Auditores Independentes	**Movimentação Mínima:**	1.000	**Tributação:**	Longo Prazo - Tabela Regressiva
Distribuidor:	BTG	**Horário Limite de movimentação:**	15:00	**Período de Carência:**	não há

Contatos

SOLIS Investimentos Ltda.
Avenida Pedroso de Moraes, 1553, 4° 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 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.

Autorregulação ANBIMA
Gestão de Recursos