

Estratégia de Investimento

O SOLIS MONTE BRAVO aloca seus recursos primordialmente em cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios selecionadas 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/consultor, 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, 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
2026	Fundo (%)	1,33%	1,14%	1,38%	1,20%	1,22%	1,30%							7,80%	111,78%
	% CDI	113,84%	113,89%	113,56%	110,08%	113,66%	116,18%							113,97%	140,20%
2025	Fundo (%)	1,22%	1,21%	1,16%	1,28%	1,32%	1,28%	1,48%	1,29%	1,43%	1,43%	1,20%	1,38%	16,86%	96,45%
	% CDI	121,26%	122,69%	120,61%	121,51%	116,45%	116,63%	116,06%	110,81%	117,30%	112,10%	113,77%	112,87%	117,80%	141,40%
2024	Fundo (%)	1,21%	1,04%	1,06%	1,15%	1,08%	1,03%	1,25%	1,08%	1,05%	1,16%	0,99%	1,14%	13,95%	68,11%
	% CDI	125,30%	129,18%	127,30%	129,10%	130,11%	130,62%	126,83%	124,46%	126,02%	124,67%	124,78%	122,63%	128,30%	144,45%
2023	Fundo (%)	1,33%	1,08%	1,40%	1,12%	1,36%	1,30%	1,27%	1,36%	1,18%	1,22%	1,14%	1,11%	15,94%	47,52%
	% CDI	118,80%	117,62%	119,18%	122,32%	121,18%	121,02%	118,84%	119,43%	120,95%	122,50%	123,89%	124,16%	122,16%	145,26%
2022	Fundo (%)	1,08%	1,04%	1,27%	1,12%	1,39%	1,30%	1,24%	1,39%	1,24%	1,22%	1,25%	1,38%	15,98%	27,24%
	% CDI	147,45%	138,39%	137,11%	134,75%	134,62%	128,56%	119,52%	118,74%	115,89%	120,01%	122,81%	122,51%	129,16%	156,57%
2021	Fundo (%)	0,43%	0,47%	0,62%	0,64%	0,70%	0,71%	0,80%	0,85%	0,85%	0,86%	1,00%	1,15%	9,49%	9,71%
	% CDI	287,53%	351,69%	314,73%	308,52%	262,54%	233,95%	225,18%	199,59%	194,10%	179,87%	171,03%	150,85%	215,86%	217,08%
2020	Fundo (%)												0,20%	0,20%	0,20%
	% CDI												272,52%	272,52%	272,52%

Rentabilidade por Período

12 meses	16,96%
24 meses	34,48%
36 meses	54,34%
Início	111,78%

Patrimônio do Fundo

PL Atual	R\$ 21.738.802,68
PL Médio 12 meses	R\$ 23.792.492,51
PL Atual Estratégia	R\$ 12.967.834.092,16
PL Médio 12 meses Estratégia	R\$ 11.672.437.699,20

Perfil de Retorno

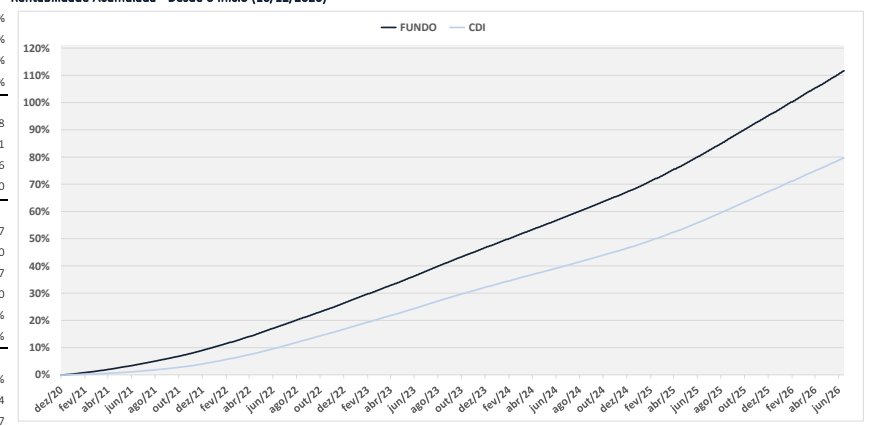
Nº de Meses Positivos - desde o início	67
Nº de Meses Negativos - desde o início	0
Meses acima do CDI - desde o início	67
Meses abaixo do CDI - desde o início	0
Maior retorno em um mês	1,48%
Menor retorno em um mês	0,43%

Perfil de Risco

Volatilidade ¹ - 12 meses	0,11%
Sharpe - 12 meses	16,74
Sharpe - 36 meses	33,27
VaR 1 mês - 95%	0,00%
VaR 12 meses - 95%	0,19%

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

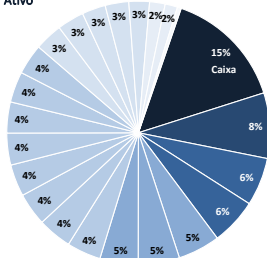
Rentabilidade Acumulada - Desde o Início (16/12/2020)

**Classificação de Risco do Fundo²**

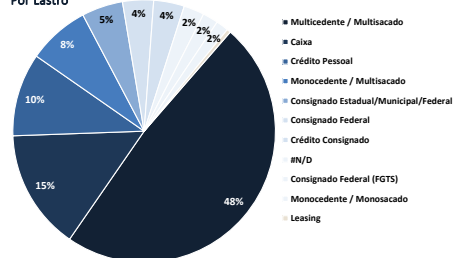
² critério qualitativo que leva em consideração prazo, riscos e estratégias das carteiras

Composição do Carteira

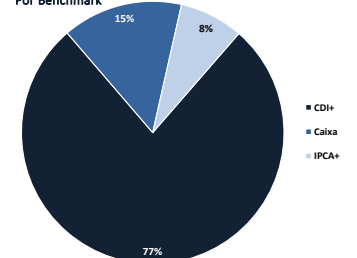
Por Ativo



Por Lastro



Por Benchmark



Características

CNPJ:	39.846.684/0001-82
Início do Fundo:	16/12/2020
Gestão:	Solis Investimentos
Administração:	BTG Pactual Serviços Financeiros
Custódia:	Banco BTG Pactual
Auditor:	PwC Auditores Independentes
Distribuidor:	XP

Cód. Anbima:	566098
Class. Anbima:	FIDC Outros
Tipo de Investidor:	Qualificado
Classificação CVM:	FIDC
Aplicação Mínima:	1.000
Movimentação Mínima:	1.000
Horário Limite de movimentação:	14:00

Cota de Aplicação:	D+0
Cota de Resgate:	D+59
Liquidação do Resgate:	D+60
Tx. Global de Remuneração:	Mín. de 0,60% e Máx. de 0,61%
Tx. de perf.:	20% que exceder 100% do CDI + 2,5% a.a.
Tributação:	Alíquota de 15%
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) 2262-8878

Fone: (21) 3262-8870
 OL-Eventos-PSE@htgnactual.com

OL-Eventos-PSF@btgpactual.com
www.btgpactual.com.br

www.btgspactual.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 são responsáveis por 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 garante 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 dos prospecto e o regulamento do fundo de investimento antes de qualquer decisão de investimento.

