

Características Gerais

Gestor: AF Invest Administração de Recursos LTDA
CNPJ Fundo: 29.044.189/0001-04
Auditoria: Ernst & Young

Posição: 31 de dezembro de 2020
Público Alvo: EFPC e Investidores em geral
Classificação CVM: Fundo de Renda Fixa
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Grau de investimento

Rentabilidades

(Início 28/03/2018)	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM.
2018														
Geraes 30			0,03%	0,75%	0,62%	0,67%	0,66%	0,83%	0,57%	0,65%	0,71%	0,70%	6,37%	6,37%
CDI			0,02%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	4,78%	4,78%
% CDI			119,9%	145,0%	120,4%	128,8%	121,6%	146,9%	122,6%	120,0%	143,7%	141,6%	133,2%	133,2%
2019														
Geraes 30	0,77%	0,60%	0,63%	0,61%	0,64%	0,52%	0,67%	0,59%	0,52%	0,34%	0,14%	0,38%	6,62%	13,41%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	11,04%
% CDI	141,5%	122,3%	135,4%	118,3%	118,2%	111,9%	118,7%	116,8%	112,5%	70,5%	37,6%	100,4%	111,0%	121,5%
2020														
Geraes 30	0,45%	0,32%	-2,95%	-2,21%	0,22%	0,73%	0,96%	0,55%	0,41%	0,24%	0,29%	0,26%	-0,81%	12,50%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%	14,11%
% CDI	119,0%	107,4%	-	90,7%	339,4%	491,5%	343,1%	263,8%	154,2%	193,6%	155,3%	-	88,6%	

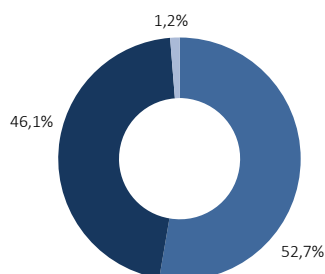
Patrimônio Atual: R\$ 279.198.739,20

Patrimônio Médio últimos 12 meses: R\$ 379.894.476,06

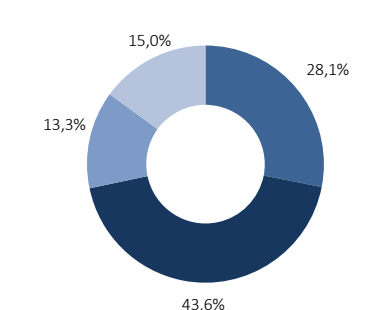
*O CDI não é meta ou parâmetro de performance do fundo, sendo tratado como referência econômica.

Indicadores

Concentração por Indexador



Concentração Faixa de Risco



■ % CDI ■ CDI + Spread ■ IPCA

■ AAA ■ AA- / AA / AA+
 ■ A- / A / A+ ■ ≤ BBB- / BBB / BBB+

Risco X Retorno

% meses acima do CDI	85,29%
% meses abaixo do CDI	14,71%
Maior retorno mensal (% CDI)	491,54%
Menor retorno mensal (% CDI)	-865,67%
Retorno últimos 12m (% CDI)	-0,81%
Retorno últimos 24m (% CDI)	5,76%
Sharpe ¹	-1,8
Volatilidade ¹	1,88%

¹12 meses

Movimentações

Taxa de ingresso e saída: Não há
Aplicação inicial mínima: R\$ 1.000,00
Movimentação mínima: R\$ 1.000,00
Saldo mínimo: R\$ 500,00
Taxa de Performance: Não há
Taxa de Administração: 0,50% a.a. (cinquenta centésimos por cento) sobre o Patrimônio Líquido podendo atingir o máximo de 0,80% (oitenta centésimos por cento).²

Aplicação: Até às 14:00hrs (D+0)
Resgate: Até às 14:00hrs (D+31, 30 dias corridos mais 1 dia útil)
Regime de Cotas: Fechamento
Constituição: 28/03/2018
Imposto de Renda: Longo Prazo conforme Tabela Regressiva
Código Anbima: 462276
Contato Gestor: (31) 2103 6000 relacionamento@afinvest.com.br

Gestor e Distribuidor

Administrador e Custodiante

Auditoria

Premiações



³ "Excelente" - Renda Fixa Crédito Duração Livre Ago/19

Dados Bancários | Favorecido: AF INVEST GERAES 30 FI RF CP CNPJ: 29.044.189/0001-04 Banco: 208 - BTG PACTUAL Agência: 001 Conta Corrente: 411811

² 0,5% a.a. (cinquenta centésimos por cento) sobre o Patrimônio Líquido (provisionada diariamente sendo paga mensalmente até o 5º dia útil subsequente ao vencimento). Tendo em vista que o FUNDO admite aplicação em cotas de fundos de investimento, esta taxa poderá atingir o máximo de 0,8% (oitenta centésimos por cento).

³ O AF Invest Geraes 30 FIRF CP foi premiado pela Revista Investidor Institucional: www.investidorinstitucional.com.br

www.afinvest.com.br

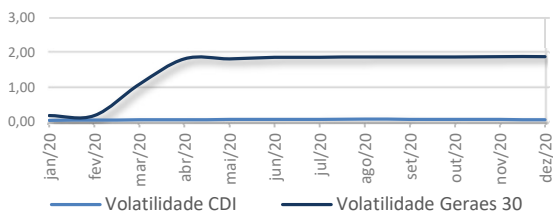


LEIA O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTA GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC.

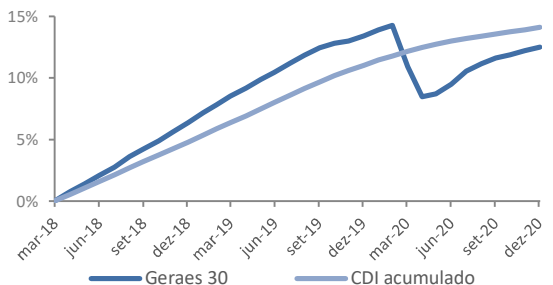
Concentração por Ativos	% PL
Debênture	38,3%
Letra Financeira Subordinada Perpétua	15,0%
Letra Financeira Subordinada	11,1%
Fundo	9,5%
Letra Financeira	8,9%
FIDC	8,9%
Operação Compromissada - Título Público	5,9%
CDB	2,6%
Nota Promissória	0,4%
Termo	0,0%
Patrimônio Líquido	100,0%

Concentração Setorial	% PL
Financeiro	47,1%
Diversos	11,6%
Água e Saneamento	6,5%
Título Público Federal	5,9%
Energia Elétrica	4,3%
Alimentos Processados	3,8%
Transporte	3,4%
Hoteis e Restaurantes	3,2%
Construção Civil	2,5%
Serviços Financeiros Diversos	2,3%
Tecidos, Vestuário e Calçados	2,0%
Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1,3%
Siderurgia e Metalurgia	1,3%
Viagens e Lazer	1,2%
Serviços Médico - Hospitalares, Análises e Diagnósticos	1,1%
Comércio	1,1%
Automóveis e Motocicletas	1,1%
Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	0,8%
Securitizadoras de Recebíveis	0,0%
Telecomunicações	0,0%
Intermediários Financeiros	0,0%
Ajuste PL	-0,5%
Total	100,0%

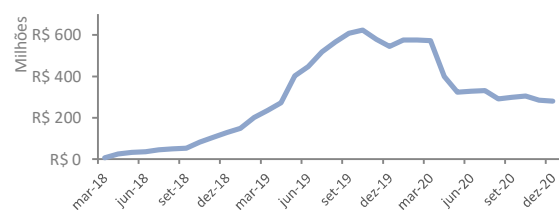
Volatilidade



Rentabilidade desde o início



Evolução do Patrimônio Líquido



Perfil de Risco

Objetivo

O objetivo do FUNDO é propiciar a valorização de suas cotas mediante a aplicação dos recursos dos cotistas, feita pelo GESTOR em ativos financeiros de alta qualidade e média/alta liquidez. Buscamos obter retorno de médio/longo prazo, superior ao CDI. Na seleção dos ativos que comporão a carteira do FUNDO, bem como em sua concentração, o GESTOR observará as melhores perspectivas de retorno para os cotistas e os limites de diversificação que sejam ou venham a ser impostos pela legislação

Política de Investimentos

Buscamos retorno acima do CDI observando as melhores perspectivas no mercado, sempre seguindo a nossa política de risco. O GERAES 30 atua no mercado primário de renda fixa (título público e privado), através da aquisição de papéis indexados ao CDI após adequada análise de crédito e posterior aprovação em Comitê. Somos muito ativos no mercado secundário de crédito privado, visando ganhos em negociações de compra/venda. Vale ressaltar que esta estratégia agrega valor ao fundo. O público alvo contempla pessoas físicas e/ou jurídicas, sem restrições, bem como Entidades Fechadas de Previdência Complementar ("EFPC").

Volatilidade

- Volatilidade Muito Baixa < 0,50%
- Volatilidade Baixa > 0,50% < 1,5%
- Volatilidade Média > 1,5% < 2%**
- Volatilidade Alta > 2% < 5%
- Volatilidade Muito Alta > 5%

Crédito Privado

- Sem Crédito Privado
- Até 30 % do PL do Fundo
- Até 50 % do PL do Fundo
- Até 70 % do PL do Fundo
- Até 100 % do PL do Fundo**

Ações

- Não possui ações em carteira**
- Até 30 % do PL do Fundo
- Até 50 % do PL do Fundo
- Até 70 % do PL do Fundo
- Até 100 % do PL do Fundo

Prazo Médio da Carteira

- Longo Prazo**
- Curto Prazo

Escala de risco

