

Características Gerais

Gestor: AF Invest Administração de Recursos LTDA
CNPJ Fundo: 09.720.734/0001-10
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 11/09/2008)		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM.
2016	FIRF Geraes	1,00%	1,03%	1,23%	1,12%	1,19%	1,24%	1,17%	1,32%	1,20%	1,18%	1,14%	1,21%	14,98%	143,04%
	CDI	1,05%	1,00%	1,16%	1,05%	1,11%	1,16%	1,11%	1,21%	1,11%	1,05%	1,04%	1,12%	14,00%	134,52%
	% CDI	94,8%	103,0%	106,3%	105,9%	107,7%	107,0%	106,1%	108,7%	108,3%	112,5%	109,7%	107,9%	107,0%	106,3%
2017	FIRF Geraes	1,17%	0,95%	1,22%	0,87%	1,04%	0,92%	1,01%	0,91%	0,76%	0,70%	0,65%	0,60%	11,35%	170,62%
	CDI	1,09%	0,87%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	0,80%	0,80%	0,64%	0,65%	0,57%	0,54%	9,95%	157,86%
	% CDI	107,7%	110,0%	116,2%	109,9%	112,7%	113,9%	125,6%	113,4%	117,9%	108,4%	114,8%	110,5%	114,0%	108,1%
2018	FIRF Geraes	0,68%	0,58%	0,62%	0,61%	0,61%	0,59%	0,59%	0,68%	0,54%	0,65%	0,55%	0,59%	7,53%	191,00%
	CDI	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	174,43%
	% CDI	116,1%	124,4%	116,0%	117,9%	118,0%	113,3%	108,7%	119,3%	115,8%	120,4%	110,9%	119,7%	117,2%	109,5%
2019	FIRF Geraes	0,61%	0,56%	0,54%	0,57%	0,57%	0,49%	0,63%	0,54%	0,48%	0,38%	0,20%	0,38%	6,13%	208,83%
	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%	190,80%
	% CDI	112,5%	114,2%	114,4%	109,2%	105,0%	105,6%	111,8%	107,4%	103,1%	79,5%	53,5%	100,6%	102,7%	109,4%
2020	FIRF Geraes	0,42%	0,29%	-1,85%	-1,64%	-0,09%	0,29%	0,56%	0,32%	0,19%	0,08%	0,22%	0,25%	-0,98%	205,79%
	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%	198,85%
	% CDI	111,9%	98,6%	-	-	-	134,7%	290,7%	197,1%	120,7%	51,2%	145,8%	151,8%	-	103,5%

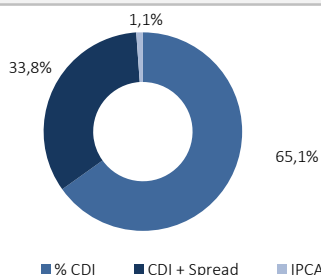
Patrimônio Atual: R\$ 896.633.353,46

Patrimônio Médio últimos 12 meses: R\$ 1.736.230.890,09

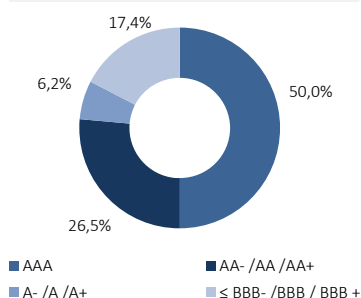
*O CDI não é meta ou parâmetro de performance do fundo, sendo tratado como referência econômica.

Indicadores

Concentração por Indexador



Concentração Faixa de Risco



Risco X Retorno

% meses acima do CDI	87,84%
% meses abaixo do CDI	12,16%
Maior retorno mensal (% CDI)	290,7%
Menor retorno mensal (% CDI)	-574,8%
Retorno últimos 12m (% CDI)	-0,98%
Retorno últimos 24m (% CDI)	5,08%
Sharpe ¹	-2,78
Volatilidade ¹	1,30%

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: 0,40% a.a. (cinquenta centésimos por cento) sobre o Patrimônio Líquido podendo atingir o máximo de 0,60% (sessenta centésimos por cento).²

Aplicação: Até às 14:00 (D+0)
Resgate: Até às 14:00 (D+1)
Regime de Cotas: Fechamento
Constituição: 11/09/2008
Imposto de Renda: Longo Prazo conforme Tabela Regressiva
Código Anbima: 216658
Contato Gestor: (31) 2103 6000
 relacionamento@afinvest.com.br

Gestor e Distribuidor

Administrador e Custodiante

Auditoria



3 Premiações

InfoMoney

1º lugar
Renda Fixa CP

Jan/20

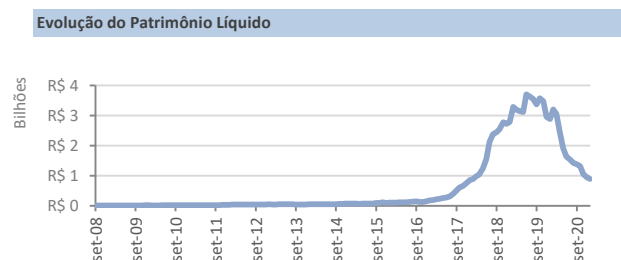
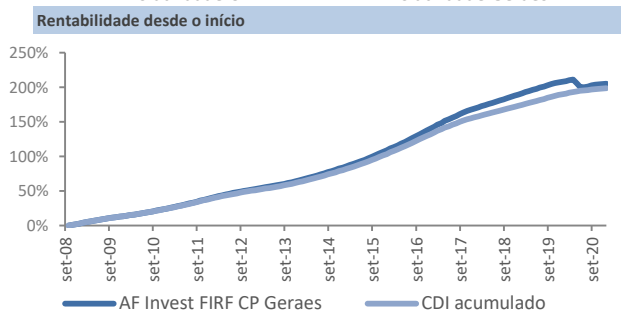
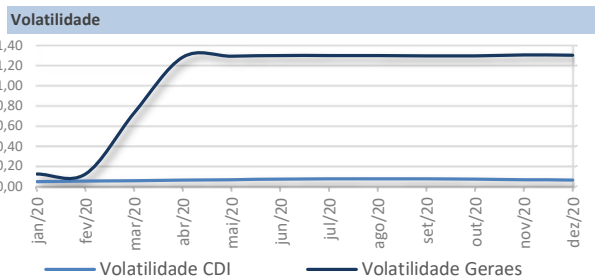
Dados Bancários | Favorecido: AF Invest FI Renda Fixa Credito Privado Geraes **CNPJ:** 09.720.734/0001-10 **Banco:** 208 - BTG PACTUAL **Agência:** 001 **Conta Corrente:** 213580

² 0,4% a.a. (quarenta 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 0,6% (sessenta centésimos por cento).

³ O AF Invest FIRF CP Geraes foi premiado pela Revista Investidor Institucional, Valor Investe Revista Exame, ISTOÉ Dinheiro e Infomoney: www.investidorinstitucional.com.br | www.valor.com.br/valor-investe | <http://www.istoedinheiro.com.br> | <https://exame.abril.com.br/> | <https://lp.infomoney.com.br/melhores-fundos-investimento-brasil>

Concentração por Ativos	% PL
Letra Financeira Subordinada	28,5%
Debênture	23,9%
Operação Compromissada - Título Público	14,1%
FIDC	8,8%
Título Público	8,5%
CDB	7,5%
Letra Financeira	5,7%
Letra Financeira Subordinada Perpétua	3,0%
Nota Promissória	0,0%
Termo	0,0%
Outros	0,0%
Patrimônio Líquido	100,0%

Concentração Setorial	%
Financeiro	44,7%
Título Público Federal	22,6%
Alimentos Processados	4,5%
Tecidos, Vestuário e Calçados	4,4%
Diversos	4,3%
Energia Elétrica	3,2%
Serviços Financeiros Diversos	3,1%
Água e Saneamento	3,0%
Hoteis e Restaurantes	2,1%
Construção Civil	2,0%
Serviços Médico - Hospitalares, Análises e Diagnósticos	1,8%
Transporte	1,5%
Petróleo, Gás e Biocombustíveis	0,8%
Automóveis e Motocicletas	0,7%
Viagens e Lazer	0,5%
Comércio	0,4%
Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	0,4%
Securitizadoras de Recebíveis	0,0%
Telecomunicações	0,0%
Intermediários Financeiros	0,0%
Ajuste PL	0,0%
Total	100,0%



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 com grau de investimento como títulos públicos e ativos de crédito privado de alta liquidez e baixo risco. Buscamos obter retorno de longo prazo, superior ao CDI. Na seleção dos ativos que compõem 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 aplicável, mantendo um perfil de atuação conservador.

Política de Investimentos

Buscamos retorno acima do CDI observando as melhores perspectivas no mercado, sempre seguindo a nossa política de risco conservadora. O GERAES 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%
- Volatilidade Média > 1% < 3,5%**
- Volatilidade Alta > 3,5% < 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

