

Características Gerais

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

Posição: 31 de maio de 2024
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.
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	141,50%	122,31%	135,37%	118,29%	118,16%	111,85%	118,67%	116,78%	112,55%	70,50%	37,64%	100,40%	110,99%	121,55%
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	118,95%	107,37%	-	-	90,71%	339,38%	491,54%	343,07%	263,79%	154,15%	193,63%	155,30%	-	88,57%
2021														
Geraes 30	0,18%	0,44%	0,42%	0,41%	0,38%	0,60%	0,55%	0,73%	0,95%	0,90%	0,59%	1,02%	7,40%	20,82%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,40%	19,13%
% CDI	123,14%	325,78%	213,54%	196,72%	142,56%	196,54%	154,38%	170,96%	215,92%	188,23%	99,80%	133,12%	168,31%	108,85%
2022														
Geraes 30	0,71%	0,88%	1,37%	1,22%	1,20%	1,08%	1,19%	1,35%	1,18%	1,18%	1,22%	1,21%	14,70%	38,58%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,37%	33,86%
% CDI	96,99%	116,84%	148,55%	146,42%	116,40%	106,32%	114,84%	115,85%	110,38%	115,86%	119,42%	107,79%	118,79%	113,91%
2023														
Geraes 30	-0,97%	-0,51%	0,67%	0,87%	1,31%	1,20%	1,21%	1,31%	1,26%	1,16%	1,24%	1,18%	10,36%	52,93%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%	51,33%
% CDI	-	-	56,92%	95,17%	116,78%	112,12%	112,91%	114,72%	128,80%	115,94%	135,61%	131,32%	79,38%	103,11%
2024														
Geraes 30	1,25%	0,89%	1,22%	1,06%	0,96%								5,49%	61,32%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%								4,40%	57,99%
% CDI	129,27%	110,94%	146,00%	119,36%	114,98%								124,82%	105,76%

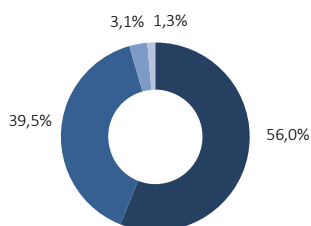
Patrimônio Atual: R\$ 250.176.624,75

Patrimônio Médio últimos 12 meses: R\$ 277.252.818,64

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

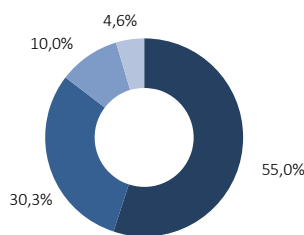
Indicadores

Concentração por Indexador



■ CDI + Spread ■ % CDI ■ IPCA ■ Pré

Concentração Faixa de Risco



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

Risco X Retorno

% meses acima do CDI	85,33%
% meses abaixo do CDI	14,67%
Maior retorno mensal (% CDI)	491,54%
Menor retorno mensal (% CDI)	-865,67%
Retorno últimos 12m (% CDI)	14,85%
Retorno últimos 24m (% CDI)	26,57%
Sharpe ¹	3,53
Volatilidade ¹	0,71%

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



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).

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 INVESTIMENTOS NÃO CONTÉM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC.

Relatório de Risco

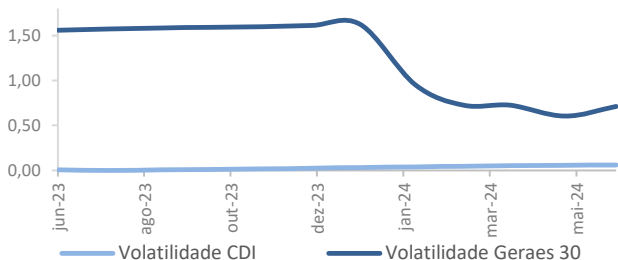
31/05/2024

Concentração por Ativos	% PL
Debênture	42,10%
Operação Compromissada - Título Público	22,58%
Letra Financeira Subordinada Perpétua	9,28%
Letra Financeira	8,27%
Fundo	6,41%
FIDC	6,32%
Letra Financeira Subordinada	6,03%
CRA	1,09%
Títulos Públicos	0,71%
Outros	-2,80%
Patrimônio Líquido	100,0%

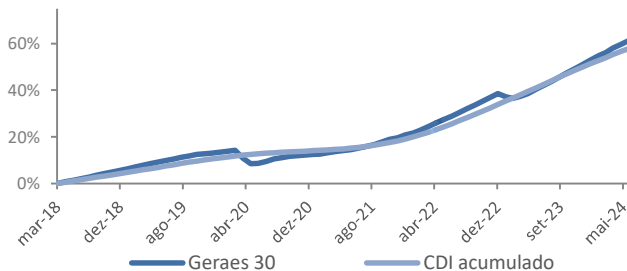
Concentração Setorial

Concentração Setorial	% PL
Financeiro	37,40%
Título Público Federal	23,29%
Serviços Médico - Hospitalares, Análises e Diagnósticos	9,98%
Energia Elétrica	6,54%
Transporte	4,47%
Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3,74%
Água e Saneamento	2,76%
Diversos	2,43%
Comércio e Distribuição	2,31%
Siderurgia e Metalurgia	1,47%
Alimentos Processados	1,34%
Comércio	1,08%
Holdings Diversificadas	1,00%
Tecidos, Vestuário e Calçados	0,83%
Materiais Básicos	0,82%
Madeira e Papel	0,81%
Intermediários Financeiros	0,65%
Máquinas e Equipamentos	0,62%
Bens Industriais	0,47%
Telecomunicações	0,42%
Construção Civil	0,36%
Ajuste PL	-2,79%
Total	100,0%

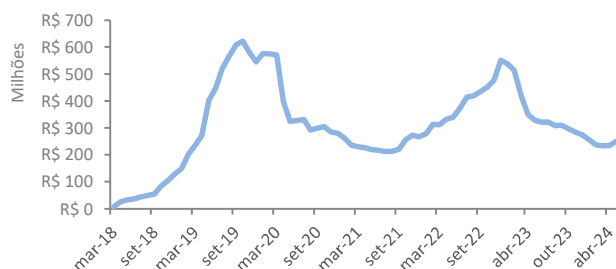
Volatilidade



Rentabilidade desde o início



Evolução do Patrimônio Líquido



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 aplicável.

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%

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

Menor risco 1 | 2 | 3 Maior risco