SOLANA EQUITY HEDGE FIC FIM

Material de Divulgação - Setembro 2024

OBJETIVOS E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

O objetivo do fundo é, por meio de aplicação em cotas do Solana Equity Hedge FIM ("Fundo Master"), proporcionar retornos reais superiores ao custo de oportunidade local, no longo prazo. Baseado em análise fundamentalista, o Fundo Master faz estratégias compradas e vendidas em ativos ligados ao mercado de renda variável, de forma a aproveitar as constantes distorções verificadas nas ações, negociando acima ou abaixo dos patamares que consideramos razoáveis. Derivativos são utilizados em boa parte das estratégias, principalmente com a finalidade de proteção e com o objetivo de maximizar o retorno de determinadas posições.

RENTABILIDADES

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum. Ano	Acum. Início
2024	FUNDO	-1.22%	-0.59%	-0.51%	-2.34%	-3.52%	-0.08%	0.83%	-0.06%	0.85%				-6.53%	128.48%
	CDI	0.97%	0.80%	0.83%	0.89%	0.83%	0.79%	0.91%	0.87%	0.83%				7.99%	86.25%
2023	FUNDO	0.14%	-2.46%	-1.44%	-1.07%	3.81%	-0.27%	2.84%	-0.65%	-0.52%	-0.52%	4.17%	2.34%	6.29%	144.43%
	CDI	1.12%	0.92%	1.17%	0.92%	1.12%	1.07%	1.07%	1.14%	0.97%	1.00%	0.92%	0.89%	13.04%	72.47%
2022	FUNDO	-1.08%	-0.81%	0.46%	2.58%	-0.67%	-0.67%	1.44%	9.77%	3.67%	2.61%	-6.05%	1.71%	12.92%	129.96%
	CDI	0.73%	0.76%	0.93%	0.83%	1.03%	1.02%	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	12.39%	52.58%
2021	FUNDO	-1.10%	3.87%	0.24%	5.28%	1.51%	2.77%	-2.03%	1.26%	0.53%	-6.54%	-1.27%	6.09%	10.40%	103.64%
	CDI	0.15%	0.13%	0.20%	0.21%	0.27%	0.31%	0.36%	0.43%	0.44%	0.49%	0.59%	0.77%	4.42%	35.76%
2020	FUNDO	2.33%	0.37%	-8.62%	4.63%	0.81%	2.94%	2.04%	2.96%	-2.73%	-1.37%	1.54%	3.80%	8.26%	84.45%
	CDI	0.38%	0.29%	0.34%	0.28%	0.24%	0.21%	0.19%	0.16%	0.16%	0.16%	0.15%	0.16%	2.76%	30.01%
2019	FUNDO	1.46%	1.31%	-0.15%	-1.31%	3.44%	-0.16%	0.87%	3.82%	-0.87%	2.11%	1.38%	2.75%	15.49%	70.38%
	CDI	0.54%	0.49%	0.47%	0.52%	0.54%	0.47%	0.57%	0.50%	0.46%	0.48%	0.38%	0.37%	5.96%	26.52%
2018	FUNDO	1.51%	2.93%	2.01%	3.57%	-0.05%	0.95%	1.80%	-0.60%	0.28%	-1.59%	-0.65%	2.65%	13.43%	47.53%
	CDI	0.58%	0.46%	0.53%	0.52%	0.52%	0.52%	0.54%	0.57%	0.47%	0.54%	0.49%	0.49%	6.42%	19.40%
2017	FUNDO	5.77%	2.13%	0.17%	0.76%	-0.97%	3.28%	2.80%	1.92%	5.84%	0.39%	-3.56%	1.91%	21.99%	30.06%
	CDI	1.08%	0.86%	1.05%	0.79%	0.93%	0.81%	0.80%	0.80%	0.64%	0.64%	0.57%	0.54%	9.93%	12.20%
2016	FUNDO											2.11%	4.41%	6.61%	6.61%
	CDI											0.93%	1.12%	2.06%	2.06%

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Rentabilidades referentes ao período desde a constituição do fundo em 03/11/2016, líquidas de taxas de administração e performance e bruta de impostos.

CARACTERISTICAS GERAIS

Início do fundo
03/11/2016
Classificação Anbima
Multimercado Livre
CNPJ
25.423.215/0001-46
Ticker Bloomberg
SOLANAF:BZ
ISIN
BRSLA6CTF006
Código ANBIMA
42803-5

Aplicação mínima inicial
R$ 100.000,00
Valor mínimo para movimentação
R$ 50.000,00
Saldo mínimo de permanência
R$ 100.000,00

Taxa de administração
1.85% a.a. sobre PL do fundo
+ 0.15% a.a. sobre PL Fundo Solana Equity Hedge FIM
Taxa de performance
20.00% do que exceder o CDI
Tributação
Longo Prazo
Tratamento tributário perseguido pelo Fundo, conforme legislação vigente. Nesse caso, o IR incidirá às seguintes alíquotas: 22.5% em aplicações com prazo de até 180 dias; 20% em aplicações de 181 dias até 360 dias; 17.5% em aplicações de 361 até 720 dias; 15% em aplicações acima de 720 dias.

Cota
Fechamento

Aplicação
Conversão de cotas: D0,
Liquidação Financeira: D0
Resgate
Cotização :
Último dia útil do mês subsequente, em caso de solicitação de resgate até o 15º dia do mês em curso.
Liquidação:
D+2 útil, após cotização

Horário de movimentações (horário de Brasília)
Aplicação: 15:30
Resgate: 15:30

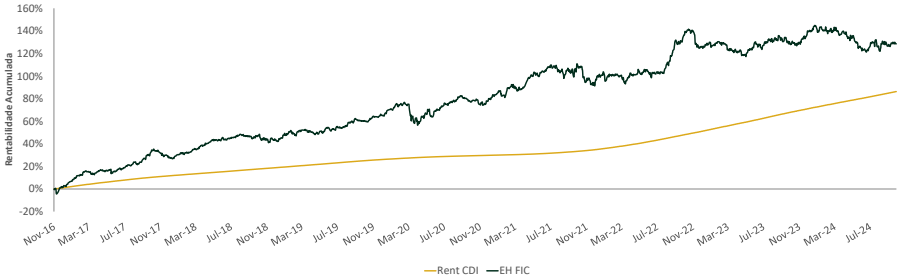
Dados Bancários:
Banco: 208
Ag: 0001
C/C: 004102007

Público alvo
Público Qualificado e Profissional

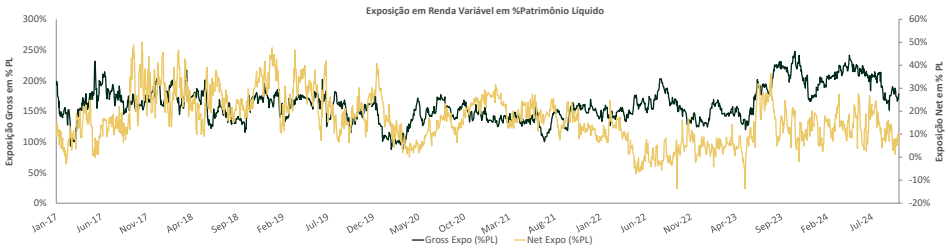
Gestor
Solana Gestora de Recursos Ltda.

Administrador
BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM
Custódia
Banco BTG Pactual S.A.
Auditor
Ernst Young

SOLANA EQUITY HEDGE FIC FIM - RENTABILIDADE E EXPOSIÇÃO



Desde 03/11/2016, data de constituição do fundo.



ANÁLISE DE CARTEIRA

		Exposição % PL [1]				Atribuição de Performance	
Setor		Long	Short	Net	Gross	Mês	Ano
	Bens Industriais	8.1%	-7.1%	1.0%	1.0%	0.00%	-0.01%
	Consumo Cíclico	21.4%	-12.3%	9.1%	22.6%	0.53%	-1.10%
	Consumo não Cíclico	8.0%	-10.9%	-2.8%	15.8%	0.16%	-0.62%
	Gold	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.00%	-0.05%
	Imobiliário	12.4%	-6.9%	5.5%	9.5%	0.18%	1.40%
	Índice - Alemanha	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.00%	-0.04%
	Índice - China	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.00%	-0.02%
	Índice - EUA	44.0%	-42.4%	1.6%	1.6%	-0.13%	-0.13%
	Índice - Ibovespa	91.4%	-101.5%	-10.0%	10.0%	0.25%	-0.31%
	Índice - Small-Cap	0.0%	-9.0%	-9.0%	9.0%	0.34%	0.18%
	Logística	0.6%	-4.4%	-3.8%	4.9%	0.67%	0.14%
	Papel e Celulose	0.3%	-2.4%	-2.1%	2.1%	0.10%	-0.80%
	Petróleo	13.0%	-14.1%	-1.1%	14.8%	-0.47%	-2.85%
	Saúde	6.8%	-2.4%	4.4%	4.4%	-0.28%	-0.56%
	Serviços Financeiros	19.1%	-13.2%	5.8%	24.4%	0.46%	-0.96%
	Siderurgia e Mineração	22.0%	-12.7%	9.3%	21.9%	-0.01%	-3.03%
	Tecnologia	4.3%	-3.7%	0.5%	2.5%	-0.05%	-0.24%
	Telecomunicações	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.00%	-0.20%
	Utilidade Pública	29.3%	-31.5%	-2.2%	36.7%	-0.63%	3.48%
	Caixa | Custos					-0.27%	-0.80%
	Total					**0.85%**	**-6.53%**

Rentabilidade líquida de taxas e bruta de impostos. [1]Distribuição com base na carteira do último dia útil mês referência.

ESTATÍSTICAS

PL Atual (em milhões)	R$ 58
PL Master Atual (em milhões)	R$ 286
PL Médio 12M (em milhões)	R$ 98
Volatilidade Anualizada	8.32%
Índice Sharpe (vs. CDI)	-

Retorno Médio Mensal	1.2%
Retorno Positivo	50
Retorno Negativo	22
Acima Benchmark	45
Abaixo Benchmark	27

Dados utilizados desde o início do fundo, utilização de retornos diários quando aplicável.

CONTATO

Solana Gestora de Recursos Ltda.
Rua Tabapuã 841, cj. 31
Itaim | São Paulo 04533-013 | Tel. +55-11-3250-4000
www.solanacapital.com.br| contato@solanacapital.com.br

BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM
Praia de Botafogo 501, 5º andar | 22250-040
Botafogo | Rio de Janeiro - RJ | Tel: +55-11-3383-2000
www.btgpactual.com/asset-management/administracao-fiduciaria

Autorregulação ANBIMA
Gestão de Recursos

DISCLAIMER: As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo de investimento ao aplicar os seus recursos. | Fundos de Investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. | Não obstante a diligência do gestor em selecionar as melhores opções de investimento, a carteira do fundo está, por sua própria natureza sujeita as flutuações de preços/ cotações de seus ativos, além de riscos de crédito e liquidez o que pode acarretar perda patrimonial do fundo. | Os fundos de ações com renda variável podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. | Este material tem o único propósito de divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela Solana, não deve ser considerado como oferta de venda de cotas de fundos de investimento ou de qualquer título ou valor mobiliário e não constitui o prospecto previsto na Instrução CVM 555 ou no Código de Auto-Regulação da ANBIMA | A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. | A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. | Este Fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus quotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado, implicando na ocorrência de patrimônio líquido do Fundo e a consequente obrigação do quotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do Fundo.| O Fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos no exterior. | IBOVESPA: Este indicador é mera referência econômica e não parâmetro objetivo do fundo.