

A GESTORA

A Miles Capital foi fundada em 2017 por um grupo de sócios com carreiras sólidas e complementares que trabalharam juntos em distintos momentos de suas carreiras no mercado de ações. Ao aliar uma sólida análise fundamentalista de longo prazo a um constante monitoramento de distorções e assimetrias de mercado, que geram oportunidades de curto e médio prazos, a Miles Capital busca entregar retornos consistentes com menor risco e volatilidade.

INFORMAÇÕES

OBJETIVO DO FUNDO

O FUNDO busca proporcionar a valorização de suas cotas através de investimentos focados no mercado de ações, com uma abordagem fundamentalista na análise de ativos de sua carteira e com um horizonte de longo prazo, sem obrigatoriamente o compromisso de concentração em nenhuma estratégia específica.

PÚBLICO ALVO

O FUNDO é destinado exclusivamente a investidores qualificados.

CATEGORIA ANBIMA

Multimercados Livre

GESTOR

Miles Capital Ltda.

ADMINISTRADOR

Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora de Valores S.A.

CUSTODIANTE

Itaú Unibanco S.A.

INFORMAÇÕES GERAIS

CNPJ: 28.069.965/0001-50

Data de início: 22/08/2017

Fundo FECHADO para captação

MOVIMENTAÇÕES

Cotização aplicação: D+1

Aplicação mínima inicial: R\$ 50.000,00

Movimentação mínima: R\$ 10.000,00

Saldo mínimo: R\$ 50.000,00

Horário de movimentação: até as 15:00

RESGATES

Cotização:

(i) com cobrança de taxa de saída: D+1

Pagamento:

3º dia útil subsequente à data de conversão

Taxa de saída antecipada:

5% sobre os valores resgatados

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

1,9% a.a. (+ 0,1% a.a. no fundo MASTER)

TAXA DE PERFORMANCE

20% da valorização da cota do FUNDO que exceder 100% do IPCA + X% a.a., sendo X a média diária das taxas indicativas dos títulos que compõem o IMA-B ponderadas pelo peso no próprio índice, divulgados pela ANBIMA.

TRIBUTAÇÃO

IR: Os rendimentos serão tributados à alíquota de 15%, exclusivamente no resgate, excetuadas as hipóteses expressamente previstas na regulamentação em vigor.

IOF: Não há incidência.

A Lâmina de Informações Essenciais do fundo pode ser encontrada no website do administrador: www.bnymellon.com.br

RENTABILIDADE MENSAL <sup>1</sup>

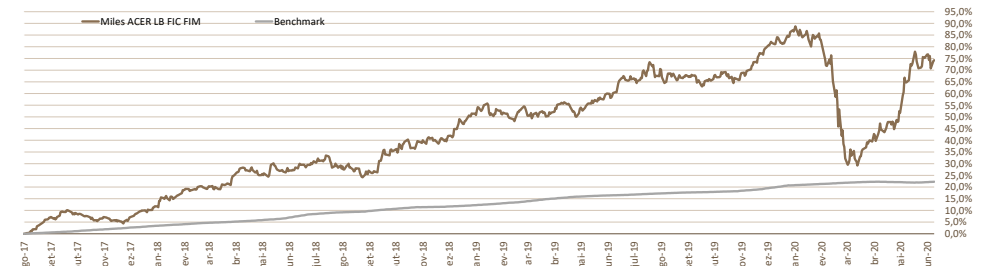
|                                | Jan   | Fev    | Mar     | Abr   | Mai    | Jun   | Jul   | Ago    | Set    | Out   | Nov    | Dez   | Ano    | Acum. <sup>2</sup> |
|--------------------------------|-------|--------|---------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------------------|
| <b>2020</b>                    |       |        |         |       |        |       |       |        |        |       |        |       |        |                    |
| Fundo                          | 1,59% | -6,63% | -23,05% | 9,42% | 13,89% | 5,76% | -     | -      | -      | -     | -      | -     | -3,80% | 74,23%             |
| Benchmark <sup>3</sup>         | 0,86% | 0,38%  | 0,47%   | 0,19% | -0,19% | 0,22% | -     | -      | -      | -     | -      | -     | 1,95%  | 22,25%             |
| PL Médio (R\$ MM) <sup>4</sup> | 22,12 | 21,83  | 17,73   | 16,56 | 18,12  | 20,77 | -     | -      | -      | -     | -      | -     | -      | -                  |
| <b>2019</b>                    |       |        |         |       |        |       |       |        |        |       |        |       |        |                    |
| Fundo                          | 7,06% | -3,09% | 0,64%   | 3,21% | -0,20% | 2,89% | 3,96% | 1,18%  | -0,47% | 0,36% | 0,87%  | 6,65% | 25,08% | 81,12%             |
| Benchmark <sup>3</sup>         | 0,60% | 0,68%  | 0,86%   | 0,98% | 0,65%  | 0,32% | 0,39% | 0,40%  | 0,28%  | 0,27% | 0,49%  | 1,10% | 7,24%  | 19,91%             |
| PL Médio (R\$ MM) <sup>4</sup> | 18,04 | 18,21  | 18,13   | 18,25 | 18,42  | 18,91 | 19,80 | 20,20  | 20,04  | 19,87 | 20,05  | 21,16 | -      | -                  |
| <b>2018</b>                    |       |        |         |       |        |       |       |        |        |       |        |       |        |                    |
| Fundo                          | 6,55% | 2,25%  | 1,48%   | 6,90% | -2,62% | 2,72% | 2,05% | -2,04% | -1,35% | 9,38% | 1,58%  | 2,94% | 33,35% | 44,80%             |
| Benchmark <sup>3</sup>         | 0,77% | 0,59%  | 0,56%   | 0,51% | 0,69%  | 1,24% | 1,21% | 0,56%  | 0,61%  | 0,90% | 0,43%  | 0,33% | 8,73%  | 11,82%             |
| PL Médio (R\$ MM) <sup>4</sup> | 12,46 | 13,07  | 13,35   | 13,75 | 14,09  | 15,26 | 15,57 | 15,53  | 15,11  | 16,10 | 16,63  | 16,86 | -      | -                  |
| <b>2017</b>                    |       |        |         |       |        |       |       |        |        |       |        |       |        |                    |
| Fundo                          | -     | -      | -       | -     | -      | -     | -     | 1,07%  | 6,07%  | 0,22% | -1,81% | 2,93% | 8,59%  | 8,59%              |
| Benchmark <sup>3</sup>         | -     | -      | -       | -     | -      | -     | -     | 0,19%  | 0,52%  | 0,68% | 0,69%  | 0,74% | 2,84%  | 2,84%              |
| PL Médio (R\$ MM) <sup>4</sup> | -     | -      | -       | -     | -      | -     | -     | 10,20  | 11,05  | 11,42 | 11,61  | 11,85 | -      | -                  |

<sup>1</sup> Rentabilidade líquida de taxas de administração e performance e bruta de impostos. <sup>2</sup> Data de início do fundo: 22/08/2017.

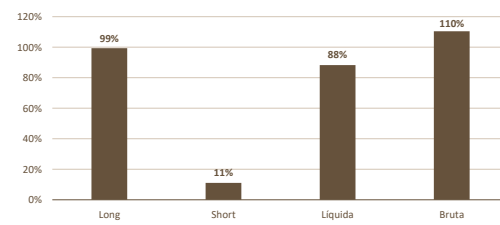
<sup>3</sup> Benchmark = IPCA + [média diária das taxas indicativas dos títulos que compõem o IMA-B ponderadas pelo peso no próprio índice, divulgados pela ANBIMA]

<sup>4</sup> Patrimônio líquido médio mensal

RENTABILIDADE ACUMULADA



EXPOSIÇÃO CONSOLIDADA [MÉDIA MENSAL]



CONCENTRAÇÃO

| % Portfólio Long | # de Ações | % Portfólio Short | # de Ações |
|------------------|------------|-------------------|------------|
| 25%              | 3          | 25%               | 2          |
| 50%              | 9          | 50%               | 3          |
| 75%              | 19         | 75%               | 4          |
| 100%             | 43         | 100%              | 7          |

CAPITALIZAÇÃO

| Valor de Mercado     | % da Exposição Bruta |
|----------------------|----------------------|
| Acima de R\$ 25 Bi   | 62,5%                |
| R\$ 5 Bi a R\$ 25 Bi | 24,4%                |
| R\$ 1 Bi a R\$ 5 Bi  | 8,1%                 |
| Até R\$ 1 Bi         | 5,0%                 |

LIQUIDEZ - RENDA VARIÁVEL

| Volume Médio Diário [30 dias] | % da Exposição Bruta |
|-------------------------------|----------------------|
| Acima de R\$ 15 MM            | 92,5%                |
| R\$ 5 MM a R\$ 15 MM          | 4,3%                 |
| R\$ 1 MM a R\$ 5 MM           | 0,0%                 |
| Até R\$ 1 MM                  | 3,1%                 |

Perfil do Portfólio em 30/06/2020.

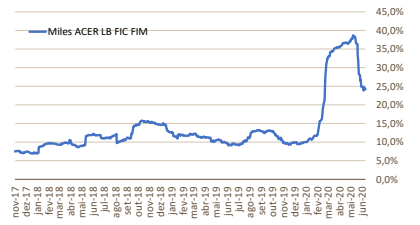
Miles Capital Ltda.

Rua Joaquim Floriano, 1052, CJ 11 | Itaim Bibi - São Paulo - SP | CEP 04534-004

Tel: (11) 3181-9159 | www.milescapital.com.br | E-mail: contato@milescapital.com.br

As informações divulgadas neste material são de caráter meramente informativo e não constituem nem devem ser entendidas como solicitação, oferta ou recomendação de compra ou venda de quotas de fundos de investimento, ou de quaisquer outros valores mobiliários. A Miles Capital não comercializa nem distribui quotas de fundos de investimento ou qualquer outro ativo financeiro. Leia o formulário de informações complementares, a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Recomendamos, ainda, uma consulta a profissionais especializados para uma análise específica e personalizada antes de tomar decisões sobre investimentos. Descrição do Tipo ANBIMA disponível no Formulário de Informações Complementares. Fundos de investimento em ações podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos decorrentes desse cenário. Os Fundos de Investimento geridos pela Miles Capital utilizam estratégias com derivativos como parte integrante de suas políticas de investimento, as quais, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Determinados Fundos geridos pela Miles Capital estão autorizados a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de saída. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro, ou ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Não há garantia de que os Fundos Multimercado terão o tratamento tributário para fundos de renda variável. O conteúdo deste material não pode ser copiado, reproduzido ou distribuído, no todo ou em parte, por qualquer meio e modo, sem a prévia e expressa autorização, por escrito, da Miles Capital. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de saída.

VOLATILIDADE ANUALIZADA [60 d.u.]



Fonte: Miles Capital

RETORNOS MENSAIS

|                            | Fundo   | Benchmark <sup>3</sup> |
|----------------------------|---------|------------------------|
| Rentabilidade 12 meses     | 8,73%   | 4,96%                  |
| Maior rentabilidade mensal | 13,89%  | 1,24%                  |
| Menor rentabilidade mensal | -23,05% | -0,19%                 |
| Meses positivos            | 26      | 34                     |
| Meses negativos            | 9       | 1                      |
| Meses acima do Benchmark   | 24      | -                      |
| Meses abaixo do Benchmark  | 11      | -                      |

PERFORMANCE

|                                       | Fundo  | Benchmark <sup>3</sup> |
|---------------------------------------|--------|------------------------|
| Retorno desde o início <sup>5</sup>   | 74,23% | 22,25%                 |
| Volatilidade anualizada <sup>5</sup>  | 16,04% | 0,29%                  |
| Índice Sharpe Anualizado <sup>5</sup> | 0,98   | -                      |
| Patrimônio líquido atual              | FIC    | R\$20.856.691          |
|                                       | MASTER | R\$2.297.664.375       |
| Patrimônio líquido médio em 12 meses  | FIC    | R\$19.889.847          |
|                                       | MASTER | R\$2.049.433.731       |

<sup>5</sup> Calculado desde a data de início do fundo: 22/08/2017.

Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora de Valores S.A.

Rua Leopoldo Couto de Magalhães Jr., 700 - 11º andar | Itaim Bibi - São Paulo - SP

CEP 04542-000 | CNPJ: 61.809.182/0001-30 | www.cshg.com.br

SAC: (11) 3701.8669 | (11) 2536.8669 | 0800 558 777

Ouvridoria: 0800 77 20 100 ou www.cshg.com.br/ouvidoria

