

Espelho Itaú Active Fix FICFI CP



Características do Fundo

Informações Essenciais

CNPJ: 20.934.408/0001-48
Código Anbima: 41617-7
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Crédito Livre
Classificação CVM: Fundo de Renda Fixa
Classificação Tributária: Longo prazo
Público Alvo: Investidores Qualificados

Política de Investimento

Objetivo: O Fundo tem como objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em cotas do Ômega AF Renda Fixa Crédito Privado Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 26.407.108/0001-97 ("Fundo Investido"). O Fundo deve manter, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seu patrimônio investido em cotas do Fundo Investido

Informações Gerais

Administrador e Gestor: Banco J.P. Morgan S.A.
Custodiante: Itaú Unibanco S.A.
Auditor: PricewaterhouseCoopers
Início do Fundo: 05/04/2016

Valores Mínimos

Aplicação inicial: R\$ 1.000,00
Movimentação: R\$ 1,00
Permanência: R\$ 1.000,00
Resgate mínimo: R\$ 1,00

Prazos

Conversão aplicação: D+0 (dias úteis)
Conversão resgate: D+5 (dias úteis)
Pagamento resgate: D+6(4)
Horário limite para Aplicação/Resgate: 15:00 hs
Carência: Não há

Taxas

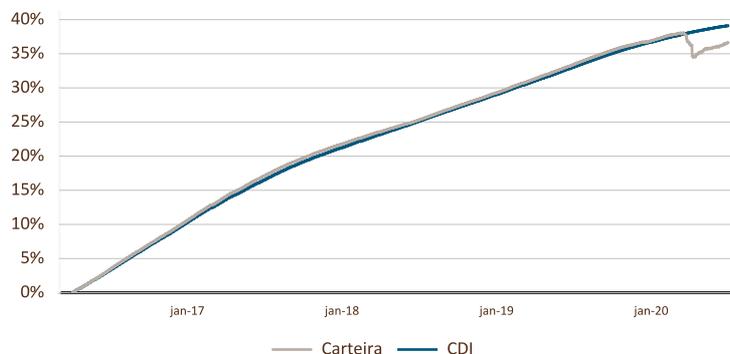
Administração: R\$ 2.500,00 mensais(5)
Performance: Não há
Entrada: Não há
Saída: Não há

Estatísticas (Últimos 12 meses)

Volatilidade: 1,28%
Sharpe: -
PL Atual: R\$ 29.794.494,83
PL Médio: R\$ 65.131.671,45
Retorno médio mensal: 0,21%
Meses positivos: 10
Meses negativos: 2
Rentabilidade: 2,48%
Rentabilidade (%CDI): 53,70%

Rentabilidade

Retorno Acumulado



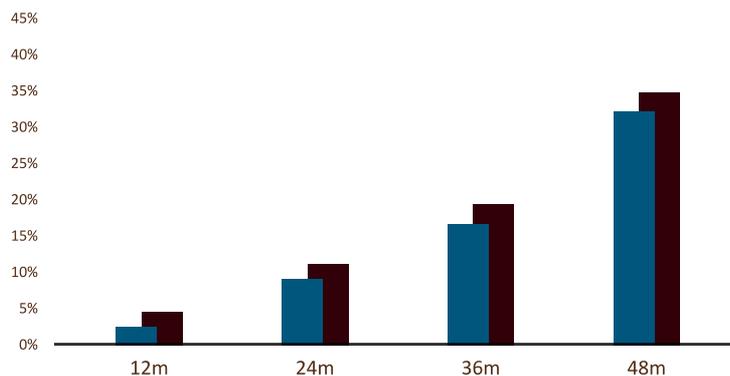
Resultados Periódicos

- 1 Retorno do Fundo em %:** Espelho Itaú Active Fix FICFI CP
- 2 Retorno do fundo em % do Benchmark⁽²⁾:** CDI
- 3 Retorno do CDI em % no período**

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	2020
1	0,43%	0,29%	-0,96%	-0,95%	0,52%	0,51%	-0,17%
2	115,12%	98,58%	-	-	217,48%	236,10%	-
3	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	1,76%

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020
1	-	-	10,54%	10,13%	6,18%	5,90%	-0,17%
2	-	-	102,91%	101,81%	96,29%	98,81%	-
3	-	-	10,24%	9,95%	6,42%	5,97%	1,76%

Resultados Agregados

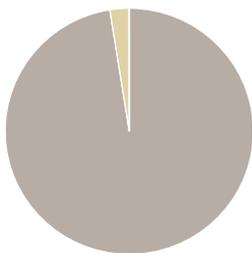


	Mês	Ano	12m	24m	36m	48m	Acum. ⁽³⁾
1	0,51%	-0,17%	2,48%	9,10%	16,72%	32,25%	36,65%
2	236,10%	-	53,70%	81,01%	86,07%	92,70%	93,73%
3	0,22%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%	34,79%	39,10%

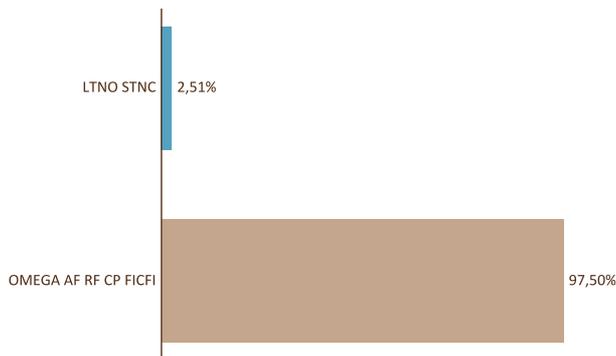
(1) O Banco J.P. Morgan S.A. classifica os fundos de investimento que administra numa escala de 1 a 5, de acordo com o risco envolvido na estratégia de investimento de cada um deles. (2) O indicador econômico apresentado trata-se de mera referência econômica e não meta ou parâmetro de performance. (3) Retorno desde o início do fundo. (4) O pagamento do resgate de cotas será realizado no primeiro dia útil subsequente à respectiva data de conversão. (5) O administrador do Ômega AF Renda Fixa Crédito Privado FICFI, (Fundo Investido) cobra uma taxa de administração correspondente a 0,35% ao ano sobre o patrimônio líquido de tal fundo, de forma que a Taxa de Administração Máxima do Fundo equivale à somatória da Taxa de Administração do Fundo Investido (i.e., 0,35% ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do Fundo Investido) adicionada ao valor de R\$2.500,00 mensais.

Composição por Classe de Ativo

- RF - Renda Fixa Brasil - Taxa Pós (97.49%)
- RF - Curto Prazo (2.51%)
- RF - Caixa (0.01%)



Alocações Relevantes



Rentabilidades Mensais (%)

1 Retorno do Fundo em %: Espelho Itaú Active Fix FICFI CP

2 Retorno do fundo em % do Benchmark ⁽²⁾: CDI

3 Retorno do CDI em % no período

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Desde início
2016 Rent	-	-	-	0,89%	1,16%	1,24%	1,18%	1,23%	1,11%	1,07%	1,05%	1,14%	10,54%	10,54%
DIF % CDI	-	-	-	99,54%	104,52%	106,78%	106,91%	101,39%	100,44%	101,89%	100,92%	101,83%	102,91%	102,91%
CDI	-	-	-	0,90%	1,11%	1,16%	1,11%	1,21%	1,11%	1,05%	1,04%	1,12%	10,24%	10,24%
2017 Rent	1,16%	0,87%	1,11%	0,83%	0,95%	0,85%	0,80%	0,78%	0,62%	0,65%	0,56%	0,51%	10,13%	21,74%
DIF % CDI	106,56%	100,46%	105,94%	105,31%	103,05%	104,82%	99,73%	97,82%	96,05%	100,92%	97,81%	94,44%	101,81%	102,48%
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%	21,21%
2018 Rent	0,55%	0,44%	0,50%	0,45%	0,46%	0,46%	0,55%	0,58%	0,47%	0,55%	0,48%	0,52%	6,18%	29,26%
DIF % CDI	94,47%	94,81%	93,56%	87,64%	88,00%	88,41%	101,91%	102,54%	101,09%	101,20%	98,25%	104,80%	96,29%	100,93%
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%	28,99%
2019 Rent	0,55%	0,52%	0,47%	0,54%	0,55%	0,48%	0,60%	0,51%	0,48%	0,47%	0,33%	0,25%	5,90%	36,89%
DIF % CDI	101,95%	105,82%	100,94%	104,31%	100,74%	101,84%	104,90%	101,02%	102,08%	96,72%	87,55%	66,76%	98,81%	100,53%
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%	36,69%
2020 Rent	0,43%	0,29%	-0,96%	-0,95%	0,52%	0,51%	-	-	-	-	-	-	-0,17%	36,65%
DIF % CDI	115,12%	98,58%	-	-	217,48%	236,10%	-	-	-	-	-	-	-	93,73%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	-	-	-	-	-	-	1,76%	39,10%

Disclaimers

Material produzido pelo Banco J.P. Morgan S.A., exclusivamente para a linha de negócios de Private Bank. Este material não constitui oferta, solicitação de compra ou de venda de qualquer instrumento financeiro em qualquer jurisdição, nem se trata de compromisso por parte do Banco J.P. Morgan S.A. ou quaisquer de suas subsidiárias (coletivamente identificadas como "J.P. Morgan Private Bank") para participar de qualquer das transações aqui mencionadas. Pode haver fatores adicionais ou diferentes que não estejam refletidos nesse material e que poderão impactar o portfólio do cliente ou sua decisão de investimento. Todas as informações fornecidas pelo J.P. Morgan Private Bank são meramente informativas e servem somente como referência econômica baseadas em determinadas suposições e nas condições atuais de mercado, estando sujeitas a alterações sem aviso prévio e não devem ser tratadas como meta ou parâmetro de performance. O presente material não deve ser a única fonte para avaliar e suportar a decisão de investimento, pois nem todas as ideias de investimento mencionadas são adequadas para todos os investidores ("Suitability"). Para a tomada de decisão, o investidor deve se basear exclusivamente na documentação oficial, inclusive, mas não se limitando, no Regulamento do Fundo de Investimentos, que contempla os termos e condições definitivos relativos aos investimentos apresentados. O Banco J.P. Morgan S.A. não presta aconselhamento jurídico, fiscal ou tributário. Sendo assim, o Cliente deve fazer uma avaliação independente das questões jurídicas, regulatórias, tributárias, fiscais, de crédito e de contabilidade e determinar, em conjunto com seus próprios consultores profissionais, se quaisquer dos investimentos aqui mencionados são adequados e apropriados aos seus objetivos pessoais. A cópia, republicação ou redistribuição do conteúdo deste material é expressamente proibida sem autorização prévia por escrito do J.P. Morgan Private Bank.

Leia atentamente o Regulamento do fundo antes de investir, inclusive, mas não se limitando, os fatores de risco relativos ao investimento no fundo. As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais solicite a sua versão mais atualizada. Antes de investir, compare o Fundo com outros da mesma classificação. Este Fundo prevê em seu regulamento que a data de solicitação do resgate é diversa da data de conversão de cota. O fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Crédito Privado - Este fundo está sujeito à risco de perda substancial de seu patrimônio líquido em cada caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos integrantes de sua carteira, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo. Não há compromisso nem garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Este Fundo pode estar exposto a significativa concentração em ativos financeiros de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Este Fundo aplica em fundos que utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo, inclusive, acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do Fundo. O indicador econômico apresentado trata-se de mera referência econômica e não meta ou parâmetro de performance. A taxa DI ou CDI corresponde à média das taxas de juros dos depósitos interbancários com prazo de um dia. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Este Fundo não conta com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo de Garantidor de Crédito – FGC. Descrição do tipo ANBIMA disponível neste material. Os investimentos apresentados podem não ser adequados aos seus objetivos, situação financeira ou necessidades individuais. Leia previamente as condições de cada produto antes de investir. Todos os documentos podem ser encontrados em <https://am.jpmorgan.com/private-bank/public/br/pt/global-offices-latam-brazil>. Supervisão e fiscalização – Comissão de Valores Mobiliários (CVM) / Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br. SAC: (011) 4950-3700 ou por meio de endereço eletrônico: private.b.bank@jpmorgan.com. Ouvidoria, por meio do telefone: 0800-7700847 e do E-mail: ouvidoria.jp.morgan@jpmorgan.com



Ouvidoria
Tel: 0800-7700847
E-mail: ouvidoria.jp.morgan@jpmorgan.com

J.P.Morgan