

Frontier Long Bias FIC FIA

Setembro 2021



Características

Início do Fundo

31/Março/2021

Aplicação Inicial

R\$ 5.000,00

Saldo e Movimentação Mínimos

R\$ 1.000,00

Cotização de Aplicação

D+1

Cotização de Resgate²

D+30

Liquidação de Resgate

2º dia útil subsequente a cotização

Horário para Movimentação

14h

Taxa de Administração

2% a.a paga mensalmente

Taxa de Performance³

20% sobre IPCA + IMA-B5+

Tributação

15% sobre ganho nominal

PL Atual - PL Médio 12 meses

R\$ 18,24MM - R\$14,34MM

Status

Aberto para aplicação

Gestora

Frontier Capital Gestão de Recursos Ltda

Administrador

Intrag

Custodiante

Itau Unibanco

Auditor

PwC

Público Alvo

Investidores Qualificados (ICVM 555)

Classificação Anbima

Ações Livre

Contatos:

Frontier Capital Gestão de Recursos Ltda

CNPJ: 18.076.466/0001-36

Rua Funchal, 263 - Cj 53

São Paulo - SP

CEP 04551-060

Tel.: 55 11 3845 1717

www.frontiercap.com.br

contato@frontiercap.com.br

Intrag DTVM LTDA

CNPJ: 62.418.140/0001-31

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.400

10º andar - São Paulo - SP

CEP 04538-132

Tel.: 0800-728-0728



Gestão de Recursos

Descrição do Fundo

O Frontier Long Bias é um fundo que se beneficia dos ganhos de seleção de ações e gestão de caixa da estratégia Long Only da gestora, complementados por proteções que reduzem a exposição às oscilações da bolsa brasileira. Tipicamente essa estratégia possui exposição comprada a ações brasileiras de 60% a 100% do patrimônio, porém com exposição líquida, após as proteções, de 30 a 70%.

Em paralelo, e sem cobrança incremental de taxa de administração, alocamos o caixa em um Portfólio Global Diversificado (PGD) que busca elevar retornos através de uma exposição global macro balanceada para navegar nos mais diversos ambientes de mercado. Como benefício adicional, o Portfólio Global Diversificado gera uma exposição cambial a moeda forte, que podemos manter de forma parcial, trazendo uma proteção adicional para o fundo.

Dessa forma, esperamos oferecer um produto que reduza risco, mas agregue retorno de forma decorrelacionada, permitindo uma travessia menos turbulenta para o investidor, sem abrir mão de seus objetivos de retorno de longo prazo.

Rentabilidade

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acumulado
Fundo				1,69%	3,52%	1,60%	0,82%	-2,10%	-3,13%				2,27%
2021				0,90%	0,92%	1,02%	1,11%	1,34%	1,46%				6,94%
IPCA + IMA-B5+ ³				1,94%	6,16%	0,46%	-3,94%	-2,48%	-6,57%				-4,85%
Ibovespa ⁴													
										Desde o Início	Fundo IPCA + IMA-B5+3 Ibovespa ⁴		2,27% 6,94% -4,85%

Portfólio (Setembro/2021)

Setores Ações Brasil (% do P	Long	Short	Net	Gross
Serviços de Comunicação	0%	-1%	-1%	1%
Consumo Discricionário	27%	-7%	20%	35%
Consumo Não-Discricionário	17%	-6%	11%	23%
Energia	7%	-3%	4%	10%
Financeiro	9%	-5%	4%	14%
Saúde	9%	-2%	8%	11%
Industrial	12%	-4%	9%	16%
Tecnologia da Informação	0%	-2%	-2%	2%
Materiais	3%	-6%	-3%	9%
Imobiliário	0%	0%	0%	0%
Utilidades Públicas	16%	-5%	11%	21%
Total	101%	-40%	61%	142%

Estratégias (% do PL)	Long	Short	Net	Gross
Ações Brasil	101%	40%	61%	142%
Macro Global	43%	6%	36%	49%
Moedas (ex BRL)	32%	14%	18%	46%

Liquidez e Capitalização de Mercado do Fundo		
% PL	Dias ¹	Volume/dia % PL
30%	2	<R\$4mm
60%	3	R\$4-10mm
90%	3	R\$10-30mm
100%	31	>R\$30mm

Concentração Ações Brasil (Long)

Número de Empresas	27
5 maiores	32% do PL
10 maiores	56% do PL

Os valores neste documento foram calculados no fechamento de 30 de Setembro de 2021.

1. Dias úteis necessários para transformar em caixa o percentual indicado da carteira, transacionando 20% do volume médio negociado nos últimos 90 dias. 2. Dias corridos. Há possibilidade de cotização de resgate em D+15 sujeita à taxa de saída de 8%, paga em benefício do fundo, com liquidação em D+17 (2 d.u. após conversão de cotas). 3. IMA-B 5+ é um índice da Anbima composto por NTN-B's com vencimentos acima de 5 anos. O valor utilizado para cobrança de performance é atualizado diariamente com base na média aritmética dos yields das NTN-B's da carteira do IMA-B 5+ negociadas no dia anterior. 4. Mera referência econômica, e não meta ou parâmetro de performance do fundo.

As tabelas e demais informações constantes neste material são meramente informativas, não constituindo oferta de venda de fundos ou tampouco indicação ou recomendação para o uso dessas informações em aplicações ou investimentos financeiros. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS E DE TAXA DE SAÍDA. A FRONTIER CAPITAL NÃO COMERCIALIZA NEM DISTRIBUI COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO OU QUALQUER OUTRO VALOR MOBILIÁRIO. Nenhuma informação deste material substitui as informações contidas nos prospectos e nos regulamentos dos fundos de investimento. LEIA O PROSPECTO E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. Os investidores não devem se basear nas informações aqui contidas sem buscar o aconselhamento de um profissional. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. Nos termos da regulamentação da ANBIMA, para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do regulamento do fundo de investimento em sua totalidade ao aplicar os seus recursos, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo e à política de investimento do fundo, bem como às disposições que tratam dos fatores de risco a que o fundo está exposto. Este fundo de cotas aplica em fundo de investimento que pode utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, se e da forma como forem adotadas, 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. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Fundos de ações podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Mais detalhes sobre o fundo podem ser consultados no seguinte endereço eletrônico: <http://www.intrag.com.br/intrag-pt/pequisa/>. Se necessário, entre em contato com a INTRAG (11) 5029-1456, dias úteis, das 9 às 18h, ou utilize o SAC Itau 0800 728 0728, todos os dias, 24h. Se desejar a reavaliação da solução apresentada após utilizar esses canais, recorra à Ouvidoria Corporativa Itau 0800 570 0011, dias úteis, das 9 às 18h, Caixa Postal nº 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, dias úteis, das 9 às 18h, 0800 722 1722.