

# Frontier Long Bias FIC FIA

Junho 2022



## 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 Resgate<sup>2</sup>**  
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 Performance<sup>3</sup>**  
20% sobre IPCA + IMA-B5+

**Tributação**  
15% sobre ganho nominal

**PL Atual - PL Médio 12 meses**  
R\$ 15,40MM - R\$15,30MM

**Status**  
Aberto para aplicação

**Gestora**  
Frontier Capital Gestão de Recursos Ltda

**Administrador**  
Intrag

**Custodiante**  
Itaú 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



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
2021	Fundo				1,69%	3,52%	1,60%	0,82%	-2,10%	-3,13%	-4,66%	-3,04%	0,06%	-5,40%
	IPCA + IMA-B5+ <sup>3</sup>				0,90%	0,92%	1,02%	1,11%	1,34%	1,42%	1,48%	1,56%	1,32%	11,62%
	Ibovespa <sup>4</sup>				1,94%	6,16%	0,46%	-3,94%	-2,48%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%	-10,13%
2022	Fundo	3,60%	-0,47%	-0,33%	-4,45%	-0,17%	-5,53%							-7,38%
	IPCA + IMA-B5+ <sup>3</sup>	1,01%	0,96%	1,43%	1,48%	1,08%	1,16%							7,34%
	Ibovespa <sup>4</sup>	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%							-5,99%
														-12,39%
										Desde o Início		Fundo IPCA + IMA-B5+3 Ibovespa <sup>4</sup>		19,81%
														-15,51%

## Portfólio (Maio/2022)

Sectores Ações Brasil (% do PL)	Long	Short	Net	Gross
Serviços de Comunicação	0%	-1%	-1%	1%
Consumo Discricionário	13%	-6%	7%	18%
Consumo Não-Discricionário	17%	-5%	12%	21%
Energia	9%	-2%	7%	11%
Financeiro	10%	-4%	6%	14%
Saúde	2%	-1%	1%	3%
Industrial	12%	-4%	8%	16%
Tecnologia da Informação	0%	-1%	-1%	1%
Materiais	7%	-4%	3%	10%
Imobiliário	0%	0%	0%	0%
Utilidades Públicas	12%	-5%	7%	17%
<b>Total</b>	<b>81%</b>	<b>-32%</b>	<b>49%</b>	<b>113%</b>

Estratégias (% do PL)	Long	Short	Net	Gross
Ações Brasil	81%	32%	49%	113%
Macro Global	21%	0%	21%	21%
Moedas (ex BRL)	21%	17%	4%	37%

Liquidez e Capitalização de Mercado do Fundo			
% PL	Dias <sup>1</sup>	Volume/dia	% PL
30%	3	<R\$4mm	3%
60%	3	R\$4-10mm	4%
90%	31	R\$10-30mm	2%
100%	101	>R\$30mm	92%

## Concentração Ações Brasil (Long)

Número de Empresas	24
5 maiores	29% do PL
10 maiores	51% do PL

Os valores neste documento foram calculados no fechamento de 30 de Junho de 2022.

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 dos fundos. 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/pesquisa/>. Se necessário, entre em contato com a INTRAG (11) 5029-1456, dias úteis, das 9 às 18h, ou utilize o SAC Itaú 0800 728 0728, todos os dias, 24h. Se desejar a reavaliação da solução apresentada após utilizar esses canais, recorra à Ouvidoria Corporativa Itaú 0800 570 0011, dias úteis, das 9 às 18h, Caixa Postal n° 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, dias úteis, das 9 às 18h, 0800 722 1722.