



**ASSET BANK**  
MANAGEMENT



# ASSET BANK FIC FIM CP

RELATÓRIO MENSAL

---

FEVEREIRO 2023

---

## PATRIMÔNIO LÍQUIDO

R\$ 46.381.081,70

---

## RENDIMENTO

% CDI 125,94

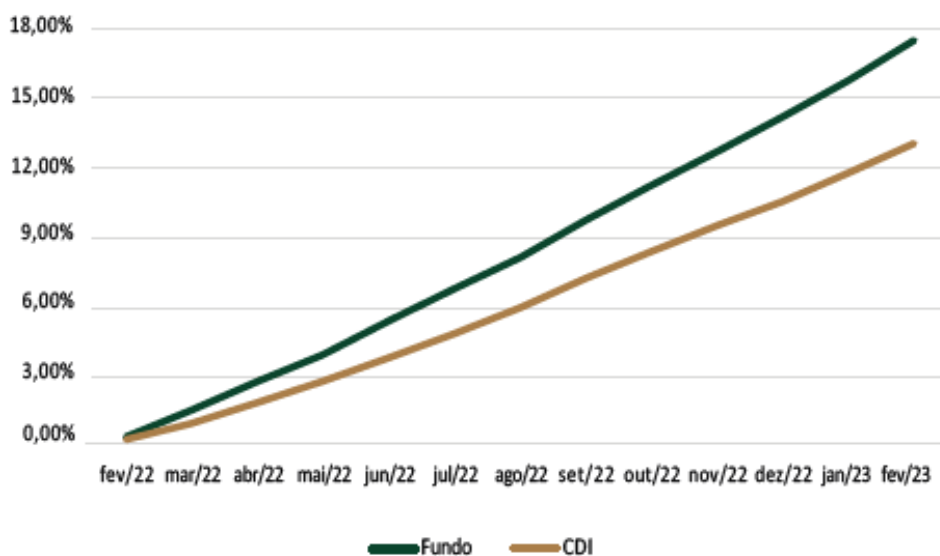
---

## RENTABILIDADE ACUMULADA

% 133,47

---

Asset Bank FIC FIM CP x CDI



\*Variação diária | Database fechamento fevereiro de 2023

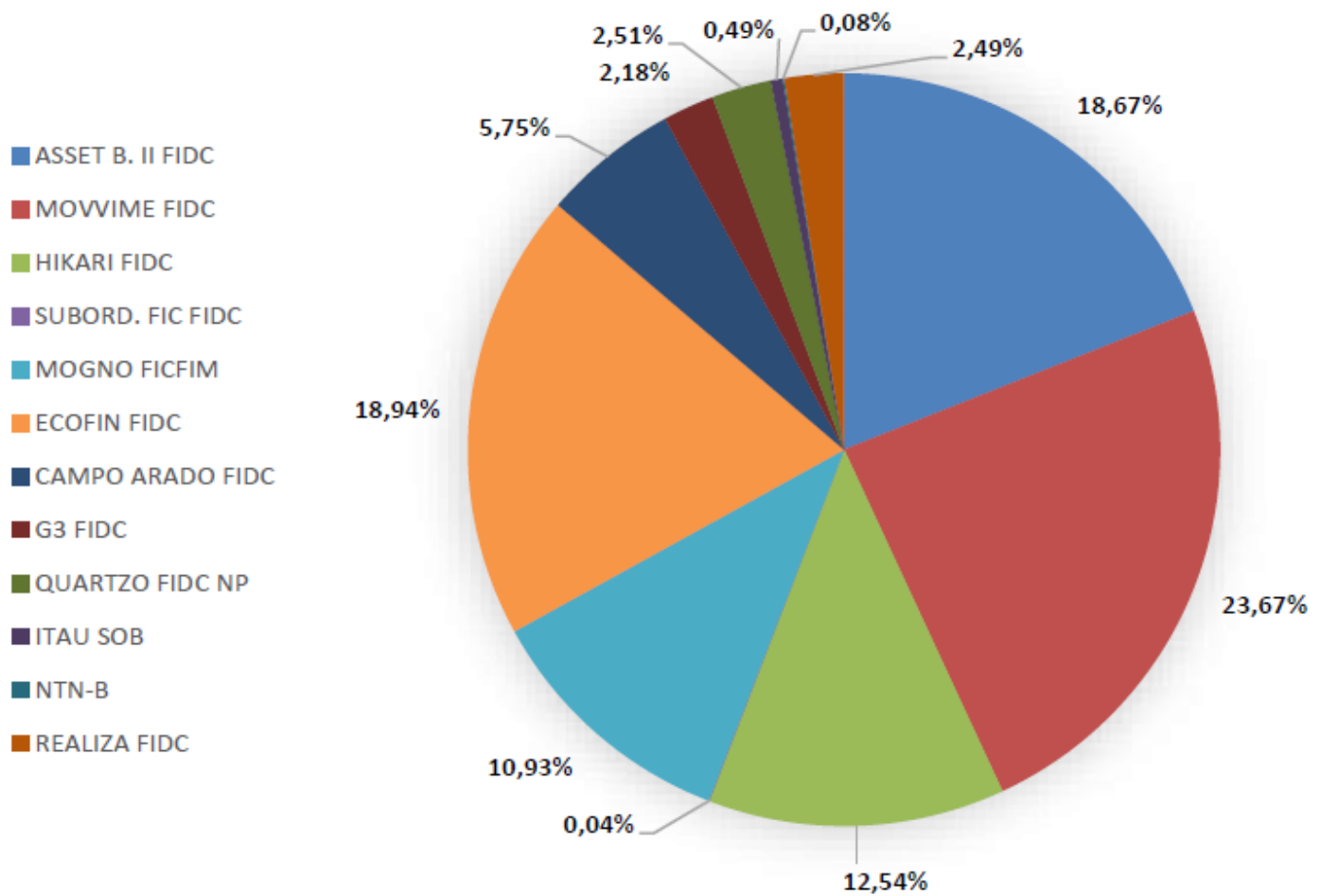
O Asset Bank FIC FIM CP, fundo multimercado para investidores qualificados, tem como objetivo retornos acima do CDI (Certificado de Depósito Interbancário) através da alocação de até 95% do Patrimônio Líquido em cotas de fundos de investimentos de crédito privado, promovendo diversificação de carteiras, baixa volatilidade e zelando pelo patrimônio investido por nossos cotistas.

O fundo tem como principal estratégia alocar seus recursos em Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDCs), preferencialmente em classe Sênior, garantindo assim uma rentabilidade atrativa perante seus pares no mercado.

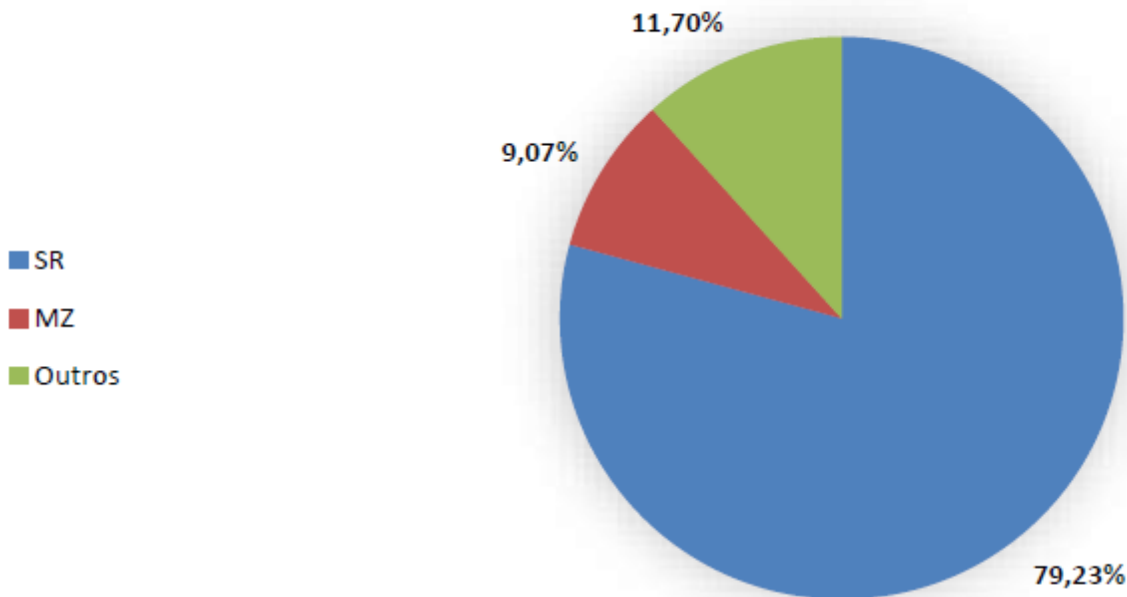
Além disso contamos com uma equipe focada em realizar uma ampla e criteriosa análise para selecionar os ativos que compõem a carteira do Asset Bank FIC FIM CP, através da análise de crédito, aliado aos balanços contábeis da empresa e aos índices de liquidez dos fundos, buscando mitigar ao máximo os riscos da operação.

Atualmente o Asset Bank FIC FIM CP fomenta nove fundos, dentre eles seis FIDCs, um FIDC NP, um FIC FIM CP e por fim um FIC FIDC, mantendo a estratégia de alocação em diferentes estruturas e nichos de mercado, garantindo a diversificação da carteira dentro de um mesmo segmento no crédito privado.

**ALOCAÇÃO ASSET BANK FIC FIM CP (FUNDOS):**



## MODALIDADE DE INVESTIMENTO ASSET BANK FIC FIM CP:



Abaixo algumas das principais características dos fundos que fazem parte da carteira do Asset Bank FIC FIM CP:

**Asset Bank II - FIDC**, que conta com mais de 2.600 sacados e um ticket médio de R\$3.900, em operações de fomento de capital de giro, em uma estratégia de crédito pulverizado e uso de garantias reais e cedentes coobrigados em momentos de aumento de concentração.

O fundo **Movvime FIDC**, que representa maior percentual dos ativos do fundo Asset Bank FIC FIM CP, com pouco mais de 20% do nosso fundo, possui a taxa híbrida (CDI+4 na cota sênior e CDI+5 na cota mezanino). Suas operações são de descontos através de portais especializados no segmento, com operações que contam com uma alta diligência da plataforma, conecta sacados e cedentes com alto nível de rating que permite apenas operações performadas, já com o aceite, comunicações com sacados e acesso à documentos disponíveis diretamente na plataforma. Em sua cadeia de sacados, o fundo apresentou operações de desconto para Petrobras, Allonda e Corsan entre outras empresas de diversos segmentos.

O **Hikari FIDC** é um FIDC de operações de crédito destinadas ao segmento de geração, manutenção e distribuição de energia elétrica, com sacados de alta confiabilidade como NeoEnergia, ENEL e CPFL entre outras companhias com alta escala e elevado rating.

Já o **Ecofinance FIDC** opera com antecipação de títulos, fomentando indústria de peças automotivas e de alumínio, os sacados são empresas de grande porte do setor.

Por fim, o **Campo Arado FIDC** atua no segmento do agronegócio na compra de direitos creditórios, destinado ao financiamento da cadeia de custeio dos produtores rurais, normalmente utilizados para compra de insumos, fertilizantes, armazenagem, transporte e demais despesas inerentes a atividade.

O Asset Bank FIC FIM CP tem meta de alocação de carteira com a concentração máxima de 5% em cada um dos FIDCs. Para tal, temos já um pipeline em FIDCs ativos, ou em fase final de estruturação, os quais em um cenário de curto prazo a médio prazo serão capazes de receber aportes em cotas principalmente em Sênior e eventualmente na subordinada mezanino.