

Objetivo
O FUNDO se classifica como um fundo de investimento em cotas de fundos da classe Renda Fixa, tendo como principal fator de risco a variação da taxa de juros domésticas e/ou de índices de preços. O FUNDO poderá aplicar os recursos integrantes de sua carteira em quaisquer ativos financeiros permitidos pela legislação aplicável, devendo-se observar, contudo, os limites de concentração e os riscos previstos em seu Regulamento.

Público Alvo
O FUNDO tem como público alvo os investidores em geral que buscam proporcionar a valorização de suas cotas através de aplicação em cotas do fundo de investimento GAUSS INCOME MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO, inscrito no CNPJ sob o n.º 25.682.025/0001-43.

Classificação Anbima: Renda Fixa - Duração Livre - Grau de Investimento

Gestor: Gauss Capital Gestora de Recursos LTDA

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros S.A.

CNPJ do Fundo: 26.434.293/0001-09

Admite Alavancagem: Não

Rentabilidades (%)*

| | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Ano | CDI | Acum. Fdo. | Acum. CDI |
|---------------------------|---------------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|---------------------------------|--------|---------------|-----------|
| 2017 | 0.35% | 0.98% | 1.15% | 0.83% | 1.01% | 0.87% | 0.79% | 0.83% | 0.65% | 0.67% | 0.62% | 0.55% | 9.71% | 9.03% | 9.71% | 9.03% |
| % CDI | 147.1% | 113.0% | 109.1% | 105.5% | 109.3% | 107.0% | 98.8% | 103.0% | 101.1% | 103.8% | 110.0% | 102.2% | 107.5% | - | 107.5% | - |
| 2018 | 0.63% | 0.48% | 0.56% | 0.54% | 0.53% | 0.56% | 0.56% | 0.59% | 0.48% | 0.56% | 0.52% | 0.56% | 6.76% | 6.42% | 17.12% | 16.03% |
| % CDI | 107.9% | 102.6% | 105.1% | 104.0% | 101.7% | 108.0% | 103.3% | 104.8% | 102.0% | 102.5% | 105.4% | 113.0% | 105.2% | - | 106.8% | - |
| 2019 | 0.58% | 0.54% | 0.49% | 0.53% | 0.55% | 0.47% | 0.57% | 0.51% | 0.47% | 0.35% | 0.11% | 0.35% | 5.67% | 5.97% | 23.76% | 22.96% |
| % CDI | 106.7% | 108.6% | 104.3% | 103.0% | 101.6% | 100.3% | 101.1% | 101.0% | 101.7% | 72.5% | 29.9% | 93.0% | 95.0% | - | 103.5% | - |
| 2020 | 0.35% | 0.20% | -3.35% | -2.07% | 0.74% | 0.16% | 0.85% | -0.07% | -0.25% | 0.13% | -0.06% | 0.90% | -2.53% | 2.77% | 20.63% | 26.36% |
| % CDI | 92.0% | 67.1% | -983.2% | -726.0% | 307.9% | 74.1% | 436.6% | -41.0% | -159.2% | 83.3% | -40.3% | 550.0% | - | - | 78.3% | - |
| 2021 | 0.28% | 0.36% | 0.61% | 0.36% | 0.37% | 0.49% | 1.09% | 1.09% | 0.08% | 0.06% | 0.09% | 0.74% | 5.26% | 4.40% | 26.98% | 31.92% |
| % CDI | 185.6% | 265.9% | 307.8% | 172.0% | 138.6% | 160.8% | 305.2% | 18.0% | 13.5% | 129.3% | 15.7% | 97.5% | 119.7% | - | 84.5% | - |
| 2022 | 0.82% | 0.85% | 1.00% | 0.78% | 1.03% | 1.13% | 0.78% | 1.19% | 1.23% | 1.05% | 1.11% | 1.31% | 13.00% | 12.37% | 43.48% | 48.24% |
| % CDI | 111.4% | 113.8% | 108.4% | 93.6% | 100.3% | 111.1% | 75.3% | 101.9% | 114.7% | 103.3% | 108.8% | 116.3% | 105.0% | - | 90.1% | - |
| 2023 | 1.03% | 0.54% | 1.16% | 0.91% | 1.36% | 1.24% | - | - | - | - | - | - | 6.41% | 6.50% | 52.68% | 57.87% |
| % CDI | 91.7% | 58.9% | 98.8% | 99.6% | 121.3% | 115.7% | - | - | - | - | - | - | 98.7% | - | 91.0% | - |
| Patrimônio líquido | 37,255,317.71 | | | | | | | | | | | | Patrimônio médio em 12 meses*** | | 47,495,927.96 | |

Rentabilidade líquida de administração e performance e bruta de impostos.

| Performance | Fundo | CDI |
|-----------------------------|--------|--------|
| Retorno anualizado | 6.83% | 7.39% |
| Rentabilidade em 12 meses | 13.71% | 13.54% |
| Número de meses positivos | 73 | 78 |
| Número de meses negativos | 5 | 0 |
| Meses acima de 100% do CDI | 55 | - |
| Meses abaixo de 100% do CDI | 23 | - |
| Maior rentabilidade mensal | 1.15% | 1.17% |
| Menor rentabilidade mensal | -3.35% | 0.13% |

| Estatísticas | Fundo | CDI |
|----------------------------|-------|-------|
| Índice de sharpe** | -0.55 | - |
| Desvio padrão anualizado** | 1.02% | 0.22% |

** Calculado desde 24/01/2017 até 30/06/2023 *** Ou desde a sua constituição, se mais recente.

Características

| | |
|---------------------------|--------------------|
| Data de Início: | 24/01/2017 |
| Aplicação Mínima: | 1,000.00 |
| Saldo Mínimo: | 1,000.00 |
| Movimentação Mínima: | 500.00 |
| Cota: | Fechamento |
| Cota aplicação: | D+0 |
| Cota resgate: | D+0 |
| Liquidação resgate: | D+1 |
| Taxa de saída antecipada: | Não há |
| Taxa de administração: | 0.45% ¹ |
| Taxa de Performance: | Não há |

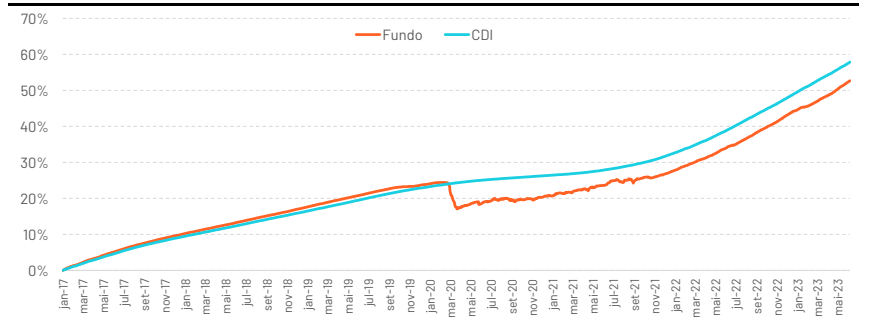
¹ A taxa de administração máxima paga pelo FUNDO, englobando a taxa de administração acima e as taxas de administração pagas pelo FUNDO nos fundos em que poderá eventualmente investir será de 1,00% a.a.

* A Gauss Capital Gestora de Recursos de Recursos LTDA não comercializa nem distribui cotas de Fundos de Investimentos. As informações contidas nesse material são de caráter exclusivamente informativo. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros: Fundos de Investimento não são garantidos pelo administrador do fundo, gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro, ou ainda, do fundo garantidor de crédito (FGC); A aplicação em fundos de investimento apresenta riscos para os investidores, podendo resultar em significativas perdas patrimoniais e a consequente perda do capital aplicado; Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do regulamento do fundo de investimento antes de efetuar qualquer decisão de investimento. Caso o índice comparativo de rentabilidade utilizado neste material, não seja o parâmetro objetivo do fundo (benchmark oficial), tal indicador é meramente utilizado como referência econômica. Para obter informações sobre o uso de derivativos, conversão de cotas, objetivo e público alvo, consulte o regulamento do fundo. Verifique a data de início das atividades deste fundo. Para avaliação da performance de fundos de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 meses. Verifique se este fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em perdas patrimoniais para seus quotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Verifique-se este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

Este fundo pode estar exposto a significativa concentração em ativos de renda variável de poucos emissores. Para fundos que persequem a manutenção de uma carteira de longo prazo, não há garantia de que o fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Os rendimentos dos cotistas estão sujeitos a: (a) IOF: de acordo com tabela regressiva em função do prazo, começando com alíquota de 98% sobre o rendimento para resgates no 1º dia útil após a aplicação e reduzindo a zero para resgates a partir do 30º dia; e (b) IR na Fonte: incide no último dia útil de maio e novembro de cada ano ("come-cotas") à alíquota de 15% sobre os rendimentos no período e, no resgate, enquanto o fundo mantiver carteira de longo prazo, o IR sobre os rendimentos será cobrado à alíquota de: (i) 22.5% em aplicações com prazo de até 180 dias; (ii) 20% em aplicações com prazo de 181 a 360 dias; (iii) 17.5% em aplicações com prazo de 361 a 720 dias; (iv) 15% em aplicações com prazo acima de 720 dias, descontados os valores adiantados em função do come-cotas. Verifique se a liquidação financeira e conversão dos pedidos de resgate deste fundo ocorrem em data diversa do respectivo pedido. A partir de 02/05/2008, todos os fundos de investimento que utilizam ativos de renda variável em suas carteiras deixam de apurar sua rentabilidade com base na cotação média das ações e passam a fazê-lo com base na cotação de fechamento destes ativos. Desta forma comparações de rentabilidade destes fundos com índices de ações devem utilizar, para períodos anteriores a 02/05/2008, a cotação média destes índices e, para períodos posteriores a esta data, a cotação de fechamento. Gauss Capital Gestora de Recursos Ltda. é a nova denominação de Credit Suisse Hedging-Griffo Asset Management Partners Gestão de Recursos S.A..

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

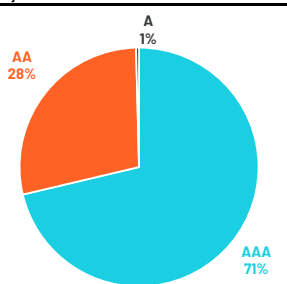
GAUSS INCOME FIC RF CP



Calculado até 30/06/2023

Fonte: Gauss Capital

Alocação de Risco



Alocação por classe de ativo

