

Visite nosso site [www.empirica.com.br](http://www.empirica.com.br) e conheça nosso portfólio de Fundos de Investimento.

Empírica Lótus | Empírica Lótus IPCA | Empírica Lótus Impacto | Gran Empírica Lótus | Empírica Lótus HY | Empírica Soberano DI

**COMENTÁRIOS DO GESTOR**

O Empírica Lótus HY apresentou um retorno de -1,16% em janeiro, ou -120,33% do CDI.

O cenário dos ativos que têm contribuído para a performance do fundo continua o mesmo: destaque positivo para o FIDC Noverde, com retornos de até 3% a.m., e os FIDC Premier Multisetorial e Premier Capital funcionando como detratores. Ambos são fundos Multicedente-Multisacado com vários devedores, que estão sendo tratados de maneira individualizada para conseguirmos reverter a situação. O impacto conjunto desses dois fundos foi de aproximadamente -2,51% na performance mensal. Nossa exposição ao FIDC Premier Multisetorial é de 0,10% e ao FIDC Premier Capital é de 6,44%, dos quais 4,07% são cotas Mezanino High Yield, para as quais estimamos uma alta volatilidade no curto prazo. Nos próximos meses, esperamos impactos de menor magnitude no Empírica Lótus HY em comparação a janeiro, e a partir de maio uma recuperação gradual dos impactos.

Seguiremos focados em aumentar a diversificação dos ativos investidos e alcançar a reversão da PDD dos produtos que impactaram a cota do Fundo no passado, como o FIDC a55 e o FIDC Premier Multisetorial, além de aumentar a liquidez da carteira.

**HISTÓRICO DE RENTABILIDADE**

Últimos 12 meses	Fundo	CDI+	% CDI
jan-24	-1,16%	-2,11%	-120,33%
dez-23	1,18%	0,29%	132,31%
nov-23	1,25%	0,33%	136,53%
out-23	0,43%	-0,57%	42,65%
set-23	-1,34%	-2,30%	-138,20%
ago-23	0,47%	-0,66%	40,91%
jul-23	0,27%	-0,80%	24,93%
jun-23	-16,14%	-17,03%	-1505,44%
mai-23	1,33%	0,21%	118,48%
abr-23	0,99%	0,07%	108,17%
mar-23	1,57%	0,39%	133,41%
fev-23	1,09%	0,17%	118,23%

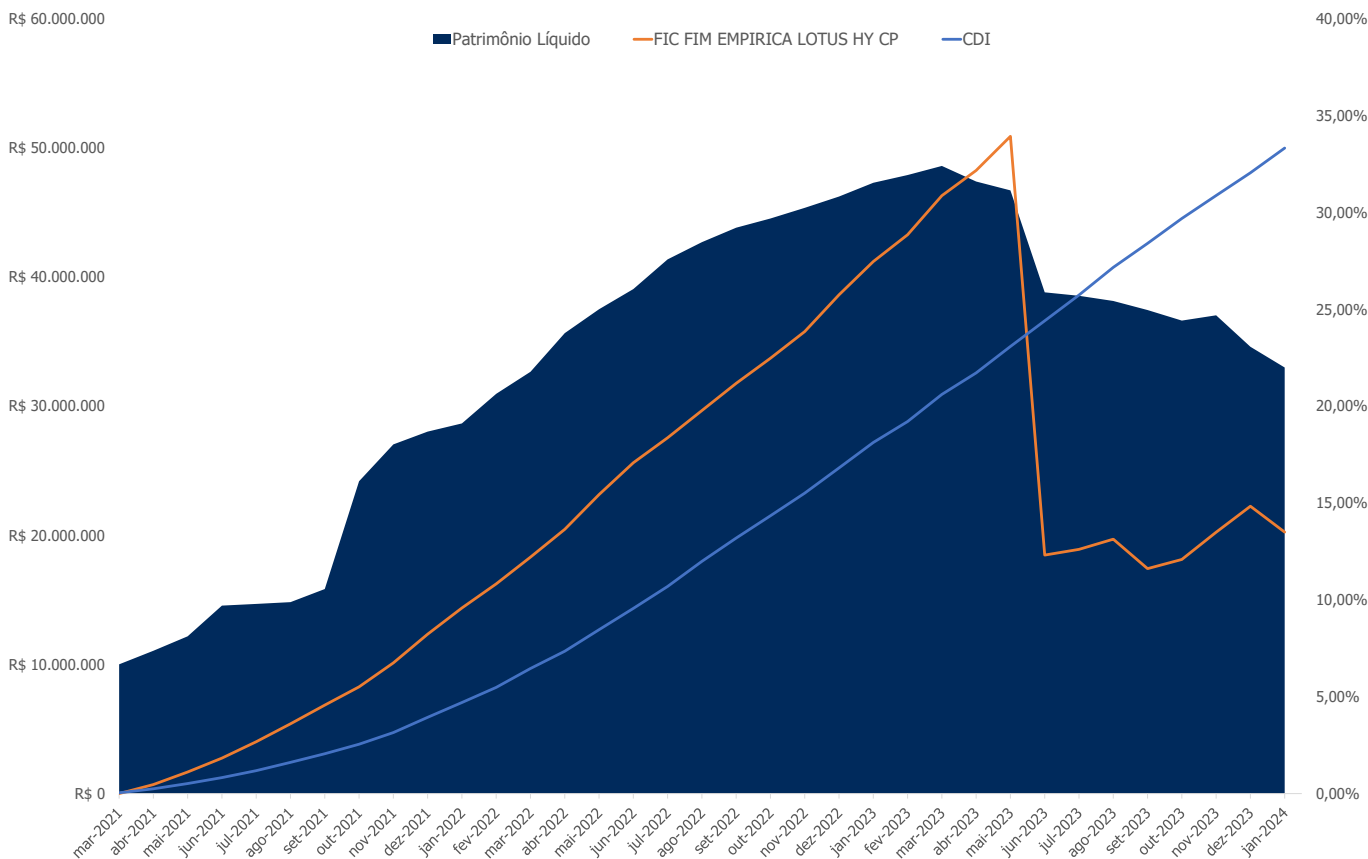
Ano a Ano	Fundo	CDI+	% CDI
2024	-1,16%	-21,67%	-120,33%
2023	-8,68%	-19,42%	-66,54%
2022	16,18%	3,39%	130,68%
2021	8,23%	5,40%	209,02%
Desde início	13,49%	-5,50%	40,50%

**ESTATÍSTICAS**

	3M	6M	12M	Ano*	Início*
FIC FIM EMPÍRICA LOTUS HY CP	1,26%	0,79%	-10,96%	-1,16%	13,49%
CDI+	-1,50%	-4,95%	-21,10%	-21,67%	-5,50%
% CDI	44,85%	13,06%	-85,16%	-120,33%	40,50%
Maior Retorno Mensal	1,25%	1,25%	1,57%	-1,16%	1,58%
Menor Retorno Mensal	-1,16%	-1,34%	-16,14%	-1,16%	-16,14%
Meses Acima do CDI	2	2	6	0	28
Meses Abaixo do CDI	1	4	6	1	6
PL Atual				R\$	32.981.740,45
PL Médio 12 Meses				R\$	40.385.996,38

\* O cálculo do CDI+ na coluna ano e início é anualizado na base de 252 dias úteis.

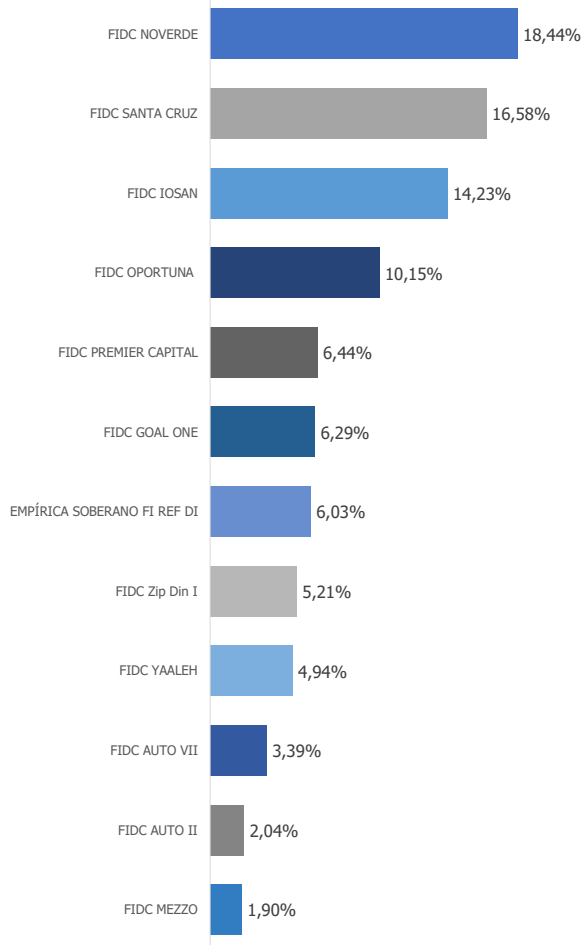
**EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE ACUMULADA**





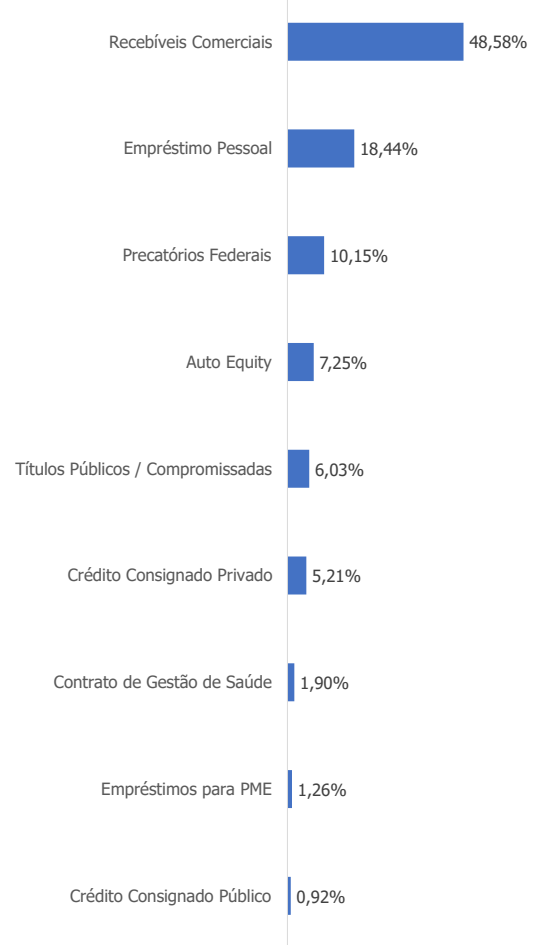
**COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR ATIVO**

(20 Maiores Ativos)

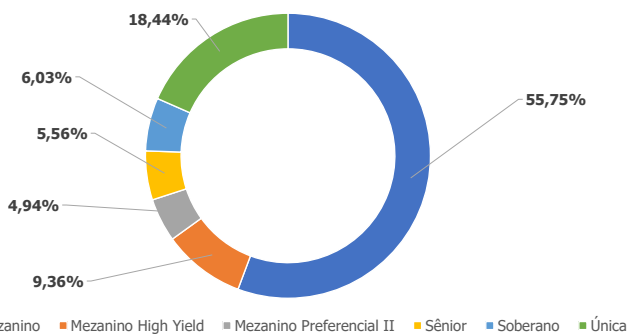


**COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR LASTRO**

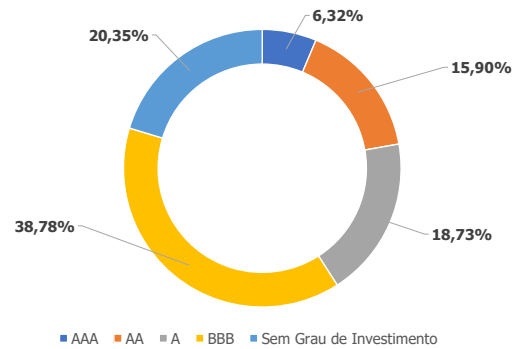
(20 Maiores Lastros)



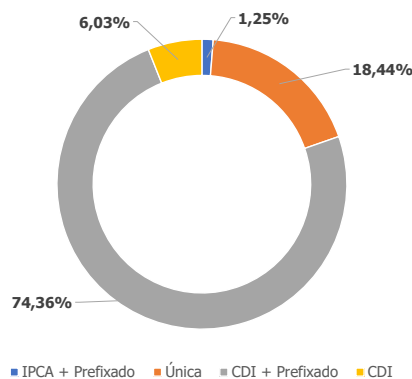
**COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR CLASSE**



**COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR RATING**



**COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR BENCHMARK**





## CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

**CNPJ** - 40.905.548/0001-03

**Tipo ANBIMA** - Multimercado Estratégia Específica

**Início do Fundo** - Maio / 2021

**Gestor** - Empírica Investimentos GR Ltda

**Administrador** - BTG Pactual Serviços Financeiros

**Custodiante** - Banco BTG Pactual

**Auditor** - Grant Thornton Auditores Independentes

**Aplicação Mínima** - R\$ 1 mil

**Aplicação Adicional** - R\$ 100

**Tx de Administração** - 1% a.a.

**Tx de Performance** - 15% sobre o que exceder 100% do CDI (semestre cível) e calculado sobre o PL do fundo.

**Cota de Aplicação** - D+0

**Cota de Resgate** - D+180 dias corridos

**Liquidação** - D+181 dias úteis

## SOBRE O FUNDO

Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado Empírica Lótus HY Crédito Privado - CNPJ: 40.905.548/0001-03, foi instituído em 25/03/2021, sob Gestão da Empírica Investimentos Gestão de Recursos Ltda. O Fundo é regido pelo seu regulamento e pela Instrução CVM nº 555/14. O regulamento pode ser obtido na sede do Administrador ou através do site da CVM ([www.cvm.gov.br](http://www.cvm.gov.br)), seção Informações de Regulados/Fundos de Investimento.

## POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O objetivo do Fundo é realizar os investimentos de seus recursos em uma carteira de investimentos composta, preponderantemente, direta ou indiretamente, por Fundos de Investimento em Direitos Creditórios, Fundos de Investimento em Direitos Creditórios Não Padronizados e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios.

## PÚBLICO-ALVO

O Fundo é destinado a Investidores Qualificados que buscam uma rentabilidade diferenciada a longo prazo, observados os riscos inerentes ao grau de volatilidade e a política de alavancagem do fundo.

## CONTATO

### Relações com Investidores - Empírica Investimentos

Ana Cintia Araújo: Head de Distribuição RI

[distribuicao@empirica.com.br](mailto:distribuicao@empirica.com.br)



Siga-nos em nossas redes sociais e mantenha-se atualizado com novidades e informação qualificada.



Ouçá nossos podcasts e inscreva-se.