

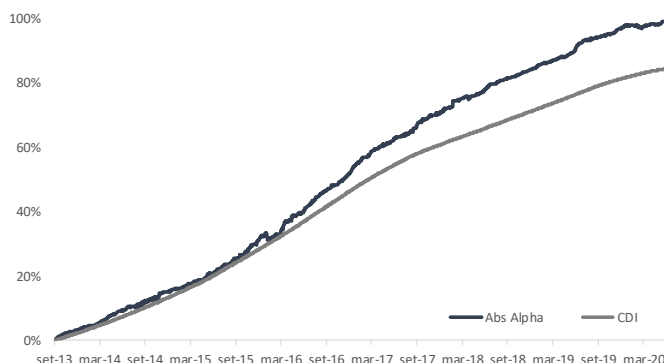
Objetivo

O fundo, através da aquisição de cotas do Absolute Alpha Master FIM, busca retornos superiores ao CDI no longo prazo, com consistência e descorrelacionados com a direção do mercado. Sua gestão busca identificar assimetrias em arbitragens lineares e não-lineares, eventos corporativos e posições long-short e direcionais oportunistas. Sua atuação tem foco em instrumentos do mercado de renda variável, e é extensível aos mercados de juros e câmbio, domésticos e internacionais.

Público Alvo

Investidores em geral.

Rentabilidade Acumulada



Rentabilidade Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2013														
Alpha										1,97%	0,76%	0,52%	3,27%	3,27%
% CDI										245%	107%	67%	142%	142%
2014														
Alpha	0,92%	0,50%	0,89%	1,30%	1,03%	1,28%	0,89%	0,91%	0,78%	0,50%	1,34%	0,67%	11,59%	15,24%
% CDI	110%	63%	117%	160%	120%	156%	95%	106%	87%	53%	160%	70%	107%	114%
2015														
Alpha	0,71%	0,53%	0,81%	0,99%	0,57%	1,45%	1,21%	0,88%	1,41%	1,07%	2,10%	1,33%	13,86%	31,21%
% CDI	76%	65%	79%	104%	58%	136%	103%	79%	127%	97%	199%	115%	105%	110%
2016														
Alpha	1,66%	-1,02%	1,66%	2,16%	1,31%	1,31%	1,57%	1,72%	1,00%	0,94%	1,06%	1,49%	15,86%	52,02%
% CDI	157%	-	143%	205%	119%	113%	141%	141%	90%	90%	102%	133%	113%	112%
2017														
Alpha	1,98%	1,17%	1,24%	0,81%	0,74%	1,03%	0,48%	0,55%	1,48%	1,01%	0,72%	0,41%	12,26%	70,66%
% CDI	182%	136%	118%	103%	80%	127%	60%	68%	232%	157%	128%	77%	123%	116%
2018														
Alpha	0,95%	1,39%	0,35%	0,07%	0,68%	0,72%	1,12%	0,58%	0,37%	0,50%	0,53%	0,46%	7,98%	84,28%
% CDI	163%	299%	65%	13%	131%	140%	206%	102%	80%	92%	108%	93%	124%	118%
2019														
Alpha	0,76%	0,30%	0,44%	0,51%	0,46%	0,68%	1,44%	0,54%	0,23%	0,33%	0,31%	0,80%	7,02%	97,21%
% CDI	140%	62%	95%	98%	84%	145%	253%	108%	49%	69%	82%	214%	118%	119%
2020														
Alpha	0,35%	-0,01%	-0,14%	0,46%	-0,06%	0,47%							1,07%	99,33%
% CDI	93%	-	-	161%	-	220%							61%	117%

Data de início: 30/09/2013

Estatísticas e PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	3	77
Meses Negativos	3	4
Meses acima do CDI	2	46
Meses abaixo do CDI	4	35
Retorno máximo mensal	0,47%	2,16%
Retorno mínimo mensal	-0,14%	-1,02%
Volatilidade anualizada	1,01%	2,28%
Índice de Sharpe	-	0,90
VaR médio (% PL)	0,12%	0,27%
Stress médio (% PL)	1,03%	4,00%

Volatilidade [mm60d]



Patrimônio líquido	R\$ 208.913.290
Patrimônio líquido médio (12m)	R\$ 297.478.945
Patrimônio líquido estratégia arbitragem	R\$ 2.818.357.126

Informações

Categoria Anbima	Multimercado Multiestratégia
Benchmark	CDI
Aplicação	Cotização e liquidação em D+0
Resgate	Cotização em D+1 e liq. em D+2 com pgto tx de saída
Taxa de Saída	5% revertida para o fundo
Isonção Tx Saída	Isenta se agendado com 17 dc de antecedência (cotização em D+17 e liquidação em D+18)
Tx Adm	Mínima de 1,90% e máxima de 2,50%
Tx Performance	20% sobre o que exceder o CDI

Gestor	Absolute Gestão de Investimentos Ltda.
Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.
Distribuidor	Consultar site do BNY Mellon
Custodiante	Banco BNY Mellon SA
Auditor	KPMG
Aplicação inicial	R\$ 50.000,00 (R\$ 5.000,00 para clientes via conta e ordem)
Movimentação	R\$ 5.000,00 (R\$ 1.000,00 para clientes via conta e ordem)
Saldo Mínimo	R\$ 25.000,00 (R\$ 3.000,00 para clientes via conta e ordem)
Código Anbid	350141

www.absoluteinvest.com.br

(11) 3199-4450

contato@absoluteinvest.com.br

Trata-se de material de divulgação cujas informações são de caráter exclusivamente informativo. A Absolute não realiza distribuição de cotas. Para isso, contate um distribuidor autorizado. A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e de taxa de saída. O fundo obteve retorno de 0,09% (9bps) através de operações objeto do Termo de Compromisso PAI F017/2014 celebrado com a Anbima. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do fundo garantidor de créditos - FGC. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 meses. Descrição do tipo ANBIMA disponível no Formulário de Informações Complementares. Leia o Prospecto, o Formulário de Informações Complementares, Lâmina de Informações Essenciais e o Regulamento antes de investir. O fundo pode estar autorizado a realizar aplicações em ativos negociados no exterior. O fundo pode estar exposto a significativa concentração em ativos de poucos emissores, sujeitando-se aos riscos daí decorrentes. Os fundos da Absolute podem utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento; tais estratégias, da forma como são 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. Não há garantia de que o fundo terá tratamento tributário para fundos de longo prazo. Esses documentos podem ser consultados no seguinte endereço eletrônico: <http://bnymellon.com.br> ou <http://absoluteinvestimentos.com.br>.



Gestão de Recursos