

Objetivo

O fundo, através da aquisição de cotas do Absolute Hedge Master FIM, busca retornos superiores ao CDI no longo prazo, através de operações direcionais e de valor relativo nos mercados de juros, câmbio e bolsa, tanto em âmbito local quanto global. Através de um processo de investimento disciplinado e de uma abordagem não-dogmática, o fundo buscará oportunidades com risco-retorno positivamente assimétricos e compatíveis com seus objetivos de retorno no longo prazo.

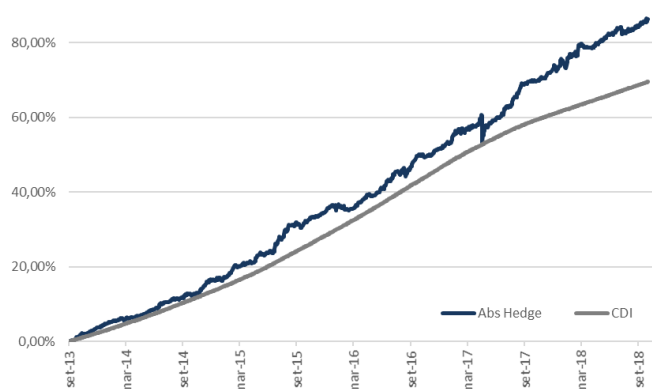
Público Alvo

Investidores em geral.

Rentabilidade mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.*
2013														
Abs Hedge										1,36%	0,97%	1,33%	3,69%	3,69%
% CDI										169%	136%	170%	160%	160%
2014														
Abs Hedge	1,19%	0,58%	0,51%	0,42%	0,86%	1,07%	1,81%	0,84%	0,47%	0,46%	1,42%	1,89%	12,14%	16,28%
% CDI	141%	74%	67%	52%	100%	131%	193%	98%	53%	49%	169%	198%	112%	122%
2015														
Abs Hedge	0,15%	1,58%	1,50%	0,79%	1,65%	0,53%	2,52%	2,13%	1,64%	0,39%	1,12%	0,84%	15,87%	34,73%
% CDI	16%	193%	145%	83%	168%	50%	214%	192%	148%	35%	106%	72%	120%	122%
2016														
Abs Hedge	0,93%	0,21%	-0,40%	1,78%	0,65%	1,20%	2,20%	0,97%	0,86%	2,46%	0,06%	1,00%	12,54%	51,63%
% CDI	88%	21%	-	169%	59%	103%	198%	80%	77%	235%	6%	89%	90%	111%
2017														
Abs Hedge	0,81%	1,81%	0,86%	0,53%	0,11%	0,95%	1,76%	1,87%	2,27%	0,51%	0,38%	1,32%	13,96%	72,80%
% CDI	75%	210%	82%	67%	12%	118%	220%	233%	356%	79%	66%	245%	141%	120%
2018														
Abs Hedge	1,42%	0,53%	1,97%	-0,52%	0,97%	0,86%	0,96%	-0,35%	0,71%	1,08%			7,86%	86,38%
% CDI	243%	114%	371%	-101%	187%	166%	178%	-62%	152%	199%			146%	124%

Rentabilidade acumulada

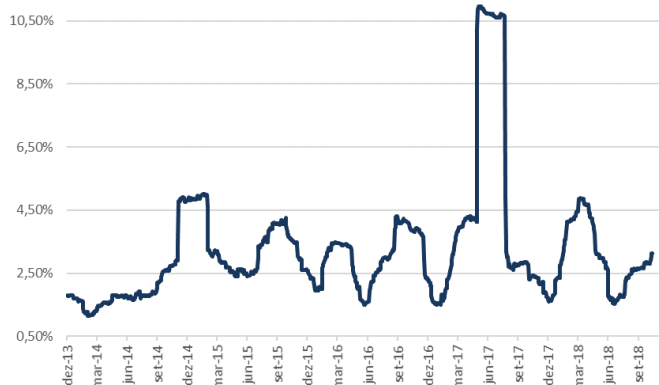


Estatísticas e PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	8	58
Meses Negativos	2	3
Meses acima do CDI	8	34
Meses abaixo do CDI	2	27
Retorno máximo mensal	1,97%	2,52%
Retorno mínimo mensal	-0,52%	-0,52%
Volatilidade anualizada	3,29%	3,71%
Índice de Sharpe	0,91	0,84
VaR médio (% PL)	0,35%	0,36%
Stress médio (% PL)	7,13%	6,80%

Patrimônio líquido	R\$ 323.380.812
Patrimônio líquido médio	R\$ 227.273.340
Patrimônio líquido estratégia macro	R\$ 3.807.529.883

Volatilidade | janela de 60 dias



Data de início: 30/09/2013

Informações

Categoria Anbima	Multimercado Macro
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
Isenção Tx Saída	Isenta se agendado com 29 dc de antecedência (cotização em D+29 e liquidação em D+30)
Tx Adm	2,00% sendo 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	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.
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	350273
CNPJ	18.860.059/0001-15

www.absoluteinvest.com.br

(11) 3199-4450

contato@absoluteinvest.com.br

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Leia o prospecto e o regulamento antes de investir. A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e de taxa de saída. 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.



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.