

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														
Hedge										1,36%	0,97%	1,33%	3,69%	4%
% CDI										169%	136%	170%	160%	160%
2014														
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%
% CDI	141%	74%	67%	52%	100%	131%	193%	98%	53%	49%	169%	198%	112%	122%
2015														
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%	35%
% CDI	16%	193%	145%	83%	168%	50%	214%	192%	148%	35%	106%	72%	120%	122%
2016														
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%	52%
% CDI	88%	21%	-	169%	59%	103%	198%	80%	77%	235%	6%	89%	90%	111%
2017														
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%	73%
% CDI	75%	210%	82%	67%	12%	118%	220%	233%	356%	79%	66%	245%	141%	120%
2018														
Hedge	1,42%	0,53%	1,97%	-0,52%	0,97%	0,86%	0,96%	-0,35%	0,71%	1,08%	0,27%	0,51%	8,70%	88%
% CDI	243%	114%	371%	-	187%	166%	178%	-	152%	199%	55%	103%	136%	123%
2019														
Hedge	2,46%	-0,54%	-0,48%	0,78%	1,34%	0,60%	-0,18%	0,33%	0,51%	1,25%	0,25%	0,86%	7,39%	102%
% CDI	453%	-	-	151%	246%	129%	-	67%	110%	260%	65%	228%	124%	125%
2020														
Hedge	0,62%	-0,63%	-0,52%	0,92%	0,12%	0,16%	0,97%	-0,07%	-0,85%	0,09%	0,78%	0,89%	2,49%	107%
% CDI	165%	-	-	324%	53%	77%	498%	-	-	56%	519%	541%	90%	123%
2021														
Hedge	-0,18%	-0,21%	0,73%	0,93%	0,30%	0,56%	0,32%	0,65%					3,13%	113%
% CDI	-	-	363%	448%	110%	181%	91%	152%					151%	125%

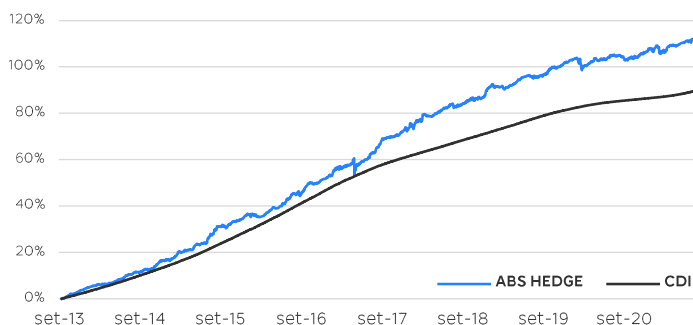
Data de início: 30/09/2013

ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	6	84
Meses Negativos	2	12
Meses acima do CDI	5	53
Meses abaixo do CDI	3	43
Retorno máximo mensal	0,93%	2,52%
Retorno mínimo mensal	-0,21%	-0,85%
Volatilidade anualizada	2,46%	3,30%
Índice de Sharpe	0,65	0,80
VaR médio (% PL)	0,47%	0,33%
Stress médio (% PL)	5,70%	5,96%
Patrimônio líquido	R\$	522.648.011
Patrimônio líquido médio	R\$	566.127.258
Patrimônio líquido estratégia macro	R\$	14.419.881.105

Categoria Anbima	Multimercado Macro
Benchmark	CDI
Aplicação	Cotização e liquidação em D+0
Resgate	Cotização em D+4 e liquidação em D+5
Taxa de Saída	Não há
Tx Adm	2% sendo mínima de 1,90% e máxima de 2,50%
Tx Performance	20% sobre o que exceder o CDI
CNPJ Código Anbid	18.860.059/0001-15 350273

RENTABILIDADE ACUMULADA



VOLATILIDADE [mm60d]



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 (R\$ 5.000 para clientes via conta e ordem)
Movimentação	R\$ 5.000 (R\$ 1.000 para clientes via conta e ordem)
Saldo Mínimo	R\$ 25.000 (R\$ 3.000 para clientes via conta e ordem)