Absolute Icatu I Prev FIC FIM

Outubro 2021

ABSOLUTE

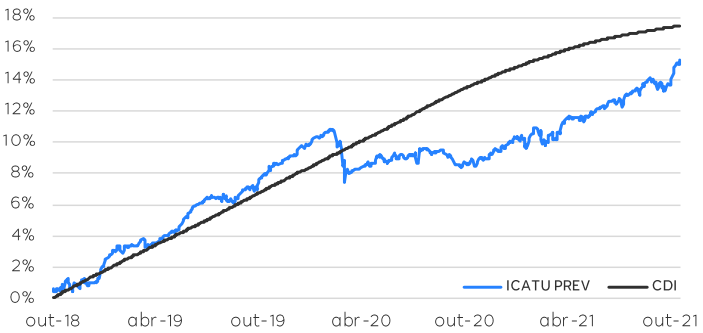
OBJETIVO

O fundo, através da aquisição de cotas do Absolute Previdenciário 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. 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

O fundo destina-se exclusivamente a investidores profissionais, admitindo especificamente o investimento de recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre (PGBL) e de Vida Gerador de Benefício Livre (VGBL) instituídos pela Icatu Seguros S.A., inscrita no CNPJ 42.283.770/0001-39.

RENTABILIDADE ACUMULADA



RENTABILIDADE MENSAL

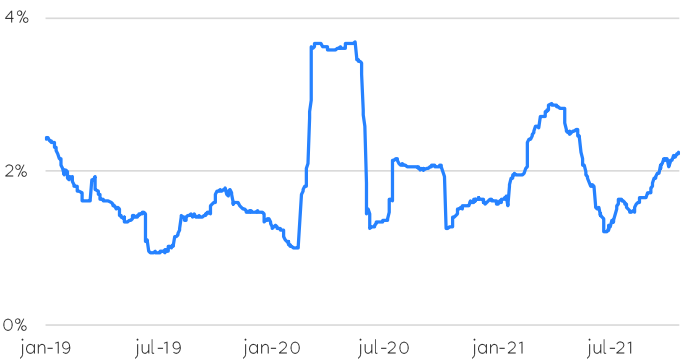
		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.*
2018	Abs Icatu I Prev										0,47%	0,06%	0,14%	0,67%	1%
	% CDI										120%	12%	29%	48%	48%
2019	Abs Icatu I Prev	1,92%	0,10%	-0,01%	0,66%	1,07%	0,92%	0,24%	0,10%	0,68%	0,94%	0,70%	0,60%	8,20%	9%
	% CDI	354%	20%	-	128%	196%	196%	42%	19%	146%	197%	184%	161%	138%	120%
2020	Abs Icatu I Prev	0,69%	-0,65%	-1,24%	0,34%	0,12%	0,13%	0,58%	-0,10%	-0,82%	-0,13%	0,74%	0,74%	0,36%	10%
	% CDI	183%	-	-	118%	52%	61%	300%	-	-	-	492%	452%	13%	97%
2021	Abs Icatu I Prev	-0,41%	0,24%	0,82%	0,73%	0,33%	0,61%	0,37%	0,75%	-0,49%	1,68%			4,71%	15%
	% CDI	-	182%	408%	351%	122%	199%	104%	175%	-	346%			156%	112%

Data de início: 08/10/2018

ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	8	28
Meses Negativos	2	8
Meses acima do CDI	8	21
Meses abaixo do CDI	2	15
Retorno máximo mensal	1,68%	1,92%
Retorno mínimo mensal	-0,49%	-1,24%
Volatilidade anualizada	2,16%	2,03%
Índice de Sharpe	0,95	0,26
VaR médio (% PL)	0,41%	0,40%
Stress médio (% PL)	4,46%	3,86%
Patrimônio líquido	R$	114.903.448
Patrimônio líquido médio	R$	114.853.554
Patrimônio líquido estratégia macro	R$	15.690.842.617

VOLATILIDADE [mm60d]



Categoria Anbima	Previdência Multimercado	Gestor	Absolute Gestão de Investimentos Ltda.
Benchmark	CDI	Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.
Aplicação	Cotização e liquidação em D+0	Distribuidor	Consultar site do BNY Mellon
Resgate	Cotização em D+0 e liquidação em D+3	Custodiante	Banco BNY Mellon SA
Taxa de Saída	Não há	Auditor	KPMG
Tx Adm	2% sendo mínima de 1,90% e máxima de 2,50%	Aplicação inicial	Não há
Tx Performance	20% sobre o que exceder o CDI	Movimentação	Não há
CNPJ | Código Anbid	28.947.266/0001-65	Saldo Mínimo	Não há

Trata-se de material de divulgação cujas informações são de caráter exlusivamente 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. 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 obrigração 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.

Autorregulação ANBIMA
Gestão de Recursos