Absolute Alpha Global FIC FIM

Maio 2022

ABSOLUTE

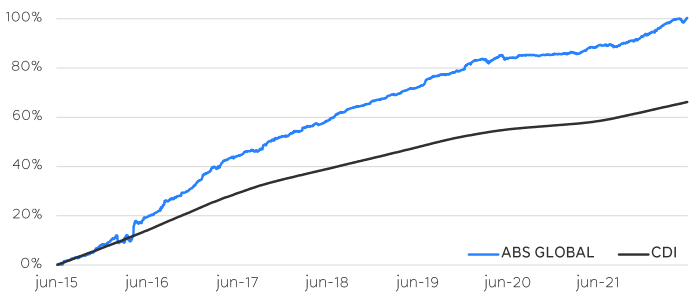
OBJETIVO

O fundo, através da aquisição de cotas do Absolute Alpha Global 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	% CDI	Acum.	% CDI
2015 Alpha Global						1,38%	1,20%	0,43%	1,07%	1,19%	2,49%	1,37%	9,49%	118%	9%	118%
2016 Alpha Global	2,34%	-2,69%	1,77%	5,38%	2,14%	1,27%	2,07%	2,42%	1,04%	1,30%	1,38%	2,33%	22,62%	162%	34%	148%
2017 Alpha Global	2,35%	1,52%	1,39%	1,29%	0,69%	1,16%	0,47%	0,05%	1,82%	0,96%	0,95%	0,38%	13,81%	139%	53%	149%
2018 Alpha Global	0,97%	1,06%	0,32%	0,38%	0,90%	1,06%	1,19%	0,98%	0,53%	0,41%	0,87%	0,43%	9,48%	148%	67%	153%
2019 Alpha Global	0,77%	0,22%	0,83%	0,67%	0,37%	0,69%	1,61%	0,68%	0,13%	0,47%	0,49%	1,46%	8,70%	146%	82%	155%
2020 Alpha Global	0,73%	0,02%	0,04%	1,04%	-0,68%	0,08%	0,62%	0,02%	-0,10%	0,11%	0,07%	0,18%	2,13%	77%	86%	151%
2021 Alpha Global	-0,02%	0,19%	0,31%	0,90%	0,29%	0,28%	-0,07%	0,12%	0,44%	0,63%	0,66%	0,79%	4,62%	104%	94%	150%
2022 Alpha Global	0,86%	0,91%	0,80%	0,36%	0,14%								3,11%	71%	100%	151%

Data de início: 29/05/2015

ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	5	80
Meses Negativos	0	5
Meses acima do CDI	2	54
Meses abaixo do CDI	3	31
Retorno máximo mensal	0,91%	5,38%
Retorno mínimo mensal	0,14%	-2,69%
Volatilidade anualizada	1,58%	2,80%
Índice de Sharpe	-	1,53
VaR médio (% PL)	0,41%	0,49%
Stress médio (% PL)	3,79%	4,55%
Patrimônio líquido	R$	842.856.486
Patrimônio líquido médio (12m)	R$	756.648.186
Patrimônio líquido estratégia arbitragem	R$	2.125.109.340

VOLATILIDADE [mm60d]

Categoria Anbima	Multimercado Multiestratégia	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+1 e liq. em D+2 com tx de saída	Custodiante	Banco BNY Mellon SA
Taxa de Saída	5% revertida para o fundo	Auditor	KPMG
Isenção Tx Saída	Isenta se agendado com 17 DC de antecedência	Aplicação inicial	R$ 50.000 (R$ 5.000 para clientes via conta e ordem)
	(cotização em D+17 e liquidação em D+18)	Movimentação	R$ 5.000 (R$ 1.000 para clientes via conta e ordem)
Tx Adm	2% sendo mínima de 1,90% e máxima de 2,50%	Saldo Mínimo	R$ 25.000 (R$ 3.000 para clientes via conta e ordem)
Tx Performance	20% sobre o que exceder o CDI	CNPJ | Código Anbid	21.983.042/0001-60 | 396729

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