

## 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

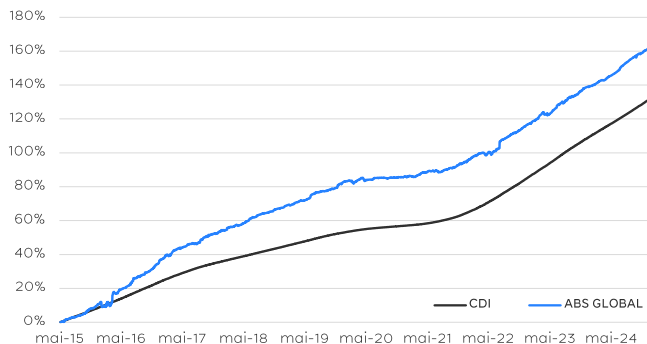
Investidores em geral.

## RENTABILIDADE 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%	148%
2022 Alpha Global	0,86%	0,91%	0,80%	0,36%	0,14%	0,21%	0,89%	2,84%	0,84%	0,94%	0,57%	1,17%	11,03%	89%	116%	138%
2023 Alpha Global	0,77%	0,69%	1,51%	0,32%	0,09%	1,39%	1,36%	0,51%	1,13%	0,36%	1,02%	0,97%	10,58%	81%	139%	128%
2024 Alpha Global	0,38%	0,55%	0,83%	0,33%	0,91%	0,72%	1,41%	0,99%	0,83%	0,84%	0,45%	0,85%	9,46%	87%	161%	123%
2025 Alpha Global	1,29%												1,29%	128%	164%	124%

Data de início: 29/05/2015

## RENTABILIDADE ACUMULADA



## ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	1	112
Meses Negativos	0	5
Meses acima do CDI	1	65
Meses abaixo do CDI	0	52
Retorno máximo mensal	1,29%	5,38%
Retorno mínimo mensal	1,29%	-2,69%
Volatilidade anualizada	1,10%	2,56%
Índice de Sharpe	2,95	1,12
VaR médio (% PL)	0,54%	0,51%
Stress médio (% PL)	2,15%	2,24%
Patrimônio líquido	R\$	84.621.038
Patrimônio líquido médio (12m)	R\$	297.014.844
Patrimônio líquido estratégia arb	R\$	316.995.488

## VOLATILIDADE [mm60d]



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

<b>Gestor</b>	Absolute Gestão de Investimentos Ltda.
<b>Administrador</b>	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.
<b>Distribuidor</b>	Consultar site do BNY Mellon
<b>Custodiante</b>	Banco BNY Mellon SA
<b>Auditor</b>	KPMG
<b>Aplicação inicial</b>	R\$ 50.000 (R\$ 5.000 para clientes via conta e ordem)
<b>Movimentação</b>	R\$ 5.000 (R\$ 1.000 para clientes via conta e ordem)
<b>Saldo Mínimo</b>	R\$ 25.000 (R\$ 3.000 para clientes via conta e ordem)
<b>CNPJ   Código Anbid</b>	21.983.042/0001-60   396729