

OBJETIVO

O fundo 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 qualificados.

RENTABILIDADE MENSAL

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	% CDI	Acum.	% CDI
2022 Vertex Prev								2,66%	3,67%	0,30%	-0,08%	0,62%	7,44%	135%	7%	131%
2023 Vertex Prev	1,06%	-0,23%	0,61%	0,41%	1,57%	3,64%	2,30%	-0,30%	-0,90%	-0,81%	3,19%	3,00%	14,15%	109%	23%	117%
2024 Vertex Prev	0,93%	1,60%	0,22%	-1,33%	0,49%	1,67%	2,21%	1,22%	0,51%	-0,31%	2,16%	-0,42%	9,28%	85%	34%	105%
2025 Vertex Prev	0,34%	0,32%	0,24%	4,22%									5,15%	126%	41%	108%

Data de início: 28/07/2022

ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	4	26
Meses Negativos	0	8
Meses acima do CDI	1	13
Meses abaixo do CDI	3	21
Retorno máximo mensal	4,22%	4,22%
Retorno mínimo mensal	0,24%	-1,33%
Volatilidade anualizada	4,57%	4,01%
Índice de Sharpe	0,74	0,29
VaR médio (% PL)	0,35%	0,45%
Stress médio (% PL)	6,53%	4,52%
Patrimônio líquido	R\$	1.262.597.604,52
Patrimônio líquido médio (12m)	R\$	1.291.169.478,50
Patrimônio líquido estratégia macro	R\$	28.388.975.622,55

Categoria Anbima	Previdência Multimercado Livre
Benchmark	CDI
Aplicação	Cotização e liquidação em D+0
Resgate	Cotização em D+21 e liquidação em D+1
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	45.681.910/0001-15

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	Não há
Movimentação	Não há
Saldo Mínimo	Não há