

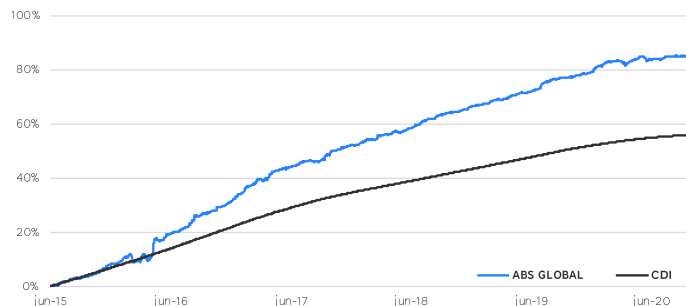
OBJETIVO

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	Acum.*
2015	Alpha Global						1,38%	1,20%	0,43%	1,07%	1,19%	2,49%	1,37%	9,49%	9%
	% CDI						130%	102%	39%	96%	108%	236%	118%	118%	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%	34%
	% CDI	221%	-	153%	510%	194%	109%	187%	199%	94%	124%	133%	208%	162%	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%	53%
	% CDI	216%	176%	132%	164%	75%	144%	58%	6%	286%	149%	167%	72%	139%	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%	67%
	% CDI	165%	229%	61%	73%	173%	205%	219%	173%	114%	76%	177%	87%	148%	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%	82%
	% CDI	142%	46%	176%	129%	67%	147%	283%	135%	27%	98%	129%	390%	146%	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%		1,95%	85%
	% CDI	193%	8%	11%	365%	-	36%	321%	12%	-	71%	44%		75%	151%

Data de início: 29/05/2015

ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	9	63
Meses Negativos	2	3
Meses acima do CDI	3	42
Meses abaixo do CDI	8	24
Retorno máximo mensal	1,04%	5,38%
Retorno mínimo mensal	-0,68%	-2,69%
Volatilidade anualizada	1,59%	3,08%
Índice de Sharpe	-	1,53
VaR médio (% PL)	0,29%	0,48%
Stress médio (% PL)	3,00%	4,32%
Patrimônio líquido	R\$	975.978.009
Patrimônio líquido médio (12m)	R\$	855.725.478
Patrimônio líquido estratégia arbitragem	R\$	3.028.454.400

VOLATILIDADE [mm60d]



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

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)
CNPJ Código Anbid	21.983.042/0001-60 412449