

Absolute Hedge FIC FIM

Dezembro 2021



OBJETIVO

O fundo, através da aquisição de cotas do Absolute Hedge 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, 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 em geral.

RENTABILIDADE MENSAL

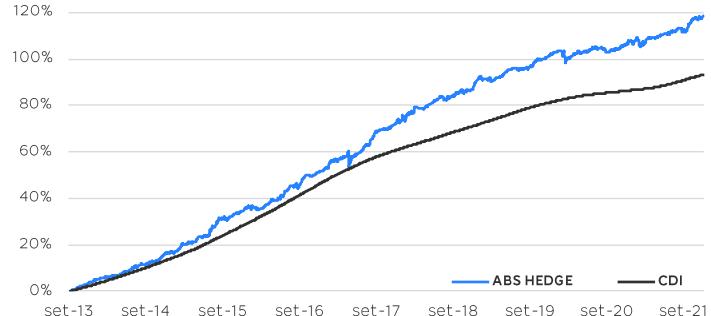
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.*		
2013	Hedge % CDI															
2014	Hedge % CDI	1,19% 141%	0,58% 74%	0,51% 67%	0,42% 52%	0,86% 100%	1,07% 131%	1,81% 193%	0,84% 98%	0,47% 53%	0,46% 49%	1,42% 169%	1,89% 136%	12,14% 170%	3,69% 160%	4% 160%
2015	Hedge % CDI	0,15% 16%	1,58% 19,3%	1,50% 14,5%	0,79% 83%	1,65% 168%	0,53% 50%	2,52% 214%	2,13% 19,2%	1,64% 14,8%	0,39% 35%	1,12% 10,6%	0,84% 72%	15,87% 120%	35% 122%	
2016	Hedge % CDI	0,93% 88%	0,21% 21%	-0,40% -	1,78% 16,9%	0,65% 59%	1,20% 103%	2,20% 198%	0,97% 80%	0,86% 77%	2,46% 235%	0,06% 6%	1,00% 89%	12,54% 90%	52% 111%	
2017	Hedge % CDI	0,81% 75%	1,81% 210%	0,86% 82%	0,53% 67%	0,11% 12%	0,95% 118%	1,76% 220%	1,87% 233%	2,27% 356%	0,51% 79%	0,38% 66%	1,32% 24,5%	13,96% 14,1%	73% 120%	
2018	Hedge % CDI	1,42% 24,3%	0,53% 114%	1,97% 371%	-0,52% -	0,97% 187%	0,86% 16,6%	0,96% 178%	-0,35% -	0,71% 152%	1,08% 199%	0,27% 55%	0,51% 103%	8,70% 136%	88% 123%	
2019	Hedge % CDI	2,46% 45,3%	-0,54% -	-0,48% -	0,78% 151%	1,34% 24,6%	0,60% 129%	-0,18% -	0,33% 67%	0,51% 110%	1,25% 26,0%	0,25% 65%	0,86% 228%	7,39% 124%	102% 125%	
2020	Hedge % CDI	0,62% 16,5%	-0,63% -	-0,52% -	0,92% 324%	0,12% 53%	0,16% 77%	0,97% 49,8%	-0,07% -	-0,85% -	0,09% 56%	0,78% 519%	0,89% 541%	2,49% 90%	107% 123%	
2021	Hedge % CDI	-0,18% -	-0,21% -	0,73% 363%	0,93% 44,6%	0,30% 110%	0,56% 181%	0,32% 91%	0,65% 152%	-0,74% -	1,93% 39,8%	0,60% 102%	0,80% 104%	5,81% 131%	119% 127%	

Data de início: 30/09/2013

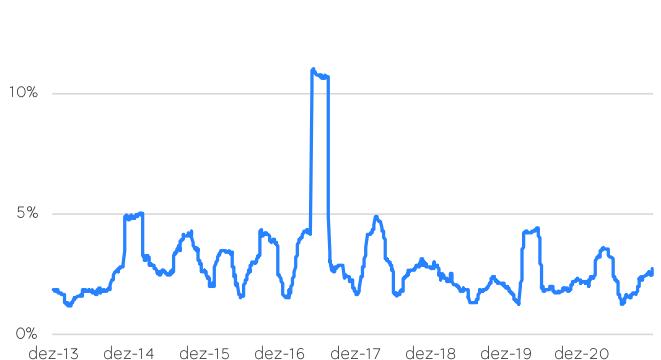
ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	9	87
Meses Negativos	3	13
Meses acima do CDI	8	56
Meses abaixo do CDI	4	44
Retorno máximo mensal	1,93%	2,52%
Retorno mínimo mensal	-0,74%	-0,85%
Volatilidade anualizada	2,51%	3,27%
Índice de Sharpe	0,56	0,85
VaR médio (% PL)	0,48%	0,34%
Stress médio (% PL)	5,19%	5,89%
Patrimônio líquido	R\$ 450.273.488	
Patrimônio líquido médio	R\$ 513.155.494	
Patrimônio líquido estratégia macro	R\$ 17.881.095.976	

RENTABILIDADE ACUMULADA



VOLATILIDADE [mm60d]



Categoria Anbima	Multimercado Macro
Benchmark	CDI
Aplicação	Cotização e liquidação em D+0
Resgate	Cotização em D+4 e liquidação em D+5
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	18.860.059/0001-15 350273

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)

absoluteinvestimentos.com.br

(11) 3199-4450

absolute@absoluteinvestimentos.com.br

Trata-se de material de divulgação cujas informações são de caráter exclusivamente 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 dos 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 arcarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação 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>.



Gestão de Recursos