Absolute Alpha Marb FIC FIM

Dezembro 2021

ABSOLUTE

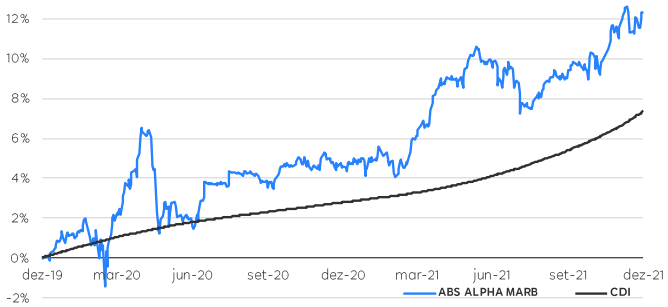
OBJETIVO

O objetivo do fundo é gerar retornos absolutos e descorrelacionados, de modo a superar o CDI no longo prazo majoritariamente através de operações de eventos corporativos (merger arbitrage). O fundo tem mandato para operar a estratégia globalmente, sendo mais recorrente operações no mercado americano.

PÚBLICO ALVO

Investidores qualificados.

RENTABILIDADE ACUMULADA

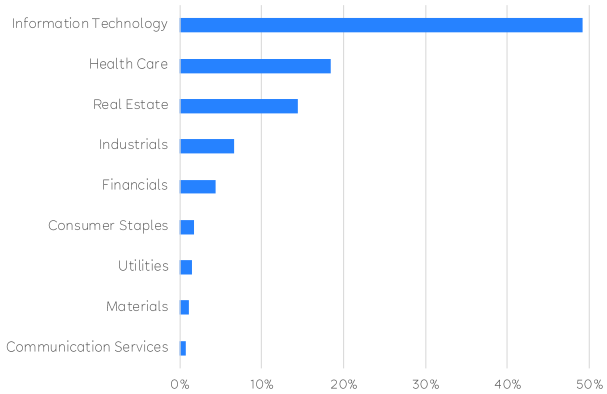


RENTABILIDADE MENSAL

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2020	Alpha Marb	1,10%	-0,50%	1,68%	3,99%	-3,70%	-0,85%	2,14%	0,37%	-0,56%	1,02%	-0,12%	0,11%	4,57%	5%
	% CDI	292%	-	497%	1402%	-	-	1100%	233%	-	648%	-	65%	166%	164%
2021	Alpha Marb	-0,12%	0,34%	1,23%	2,38%	0,84%	0,24%	-0,80%	-0,48%	0,54%	1,20%	1,08%	0,77%	7,41%	12%
	% CDI	-	254%	611%	1147%	310%	76%	-	-	122%	247%	183%	99%	167%	168%

Data de início: 27/12/2019

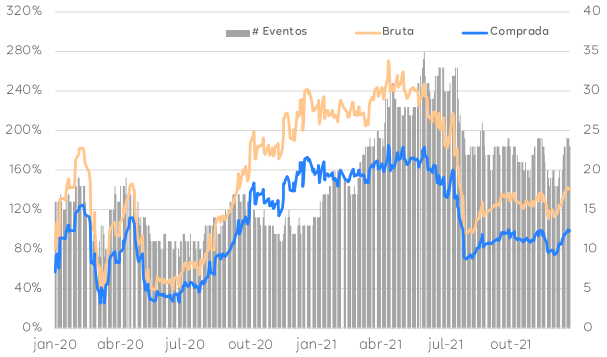
EVENTOS POR SETOR [exposição]



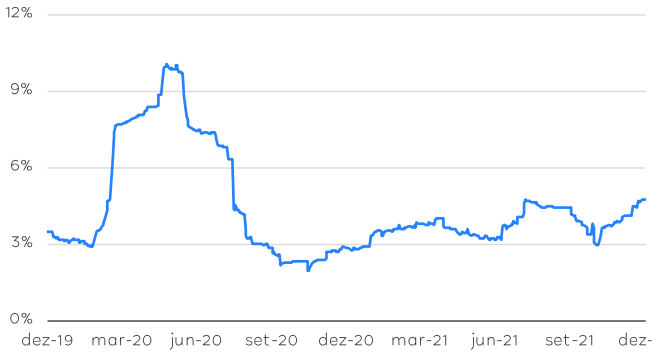
ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o início
Meses Positivos	9	16
Meses Negativos	3	8
Meses acima do CDI	7	13
Meses abaixo do CDI	5	11
Retorno máximo mensal	2,38%	3,99%
Retorno mínimo mensal	-0,80%	-3,70%
Volatilidade anualizada	4,05%	4,89%
Índice de Sharpe	0,74	0,50
VaR médio (% PL)	1,97%	1,67%
Stress médio (% PL)	19,15%	14,82%
Patrimônio líquido	R$	790.386.352
Patrimônio líquido médio (12m)	R$	628.156.040
Patrimônio líquido estratégia arbitragem	R$	2.589.769.190

EXPOSIÇÃO E QUANTIDADE DE EVENTOS [diária]



VOLATILIDADE [mm60d]



Categoria Anbima	Multimercado Multiestratégia
Benchmark	CDI
Aplicação	Cotização e liquidação em D+0
Resgate	Cotização em D+17 e liq. em D+18
Taxa de Saída	5% revertida para o fundo
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	35.618.055/0001-44 | 519790

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 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. Esse fundo tem menos de 12 meses de existência. 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