

OBJETIVO

O fundo, através da aquisição de cotas do Absolute Vertex 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

2015	Vertex II	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	% CDI	Acum.	% CDI
		0,23%	147%	0%	147%												
2016	Vertex II	0,93%	-0,34%	-1,65%	2,50%	0,39%	1,41%	3,08%	0,94%	0,81%	3,62%	-0,44%	1,06%	12,90%	92%	13%	93%
2017	Vertex II	0,71%	2,70%	0,93%	0,43%	-1,27%	1,74%	2,77%	2,79%	4,08%	0,54%	0,33%	2,26%	19,43%	196%	35%	138%
2018	Vertex II	2,32%	0,78%	3,63%	-1,44%	1,54%	1,31%	1,56%	-1,02%	1,10%	1,61%	0,22%	0,70%	12,90%	201%	53%	157%
2019	Vertex II	4,48%	-1,39%	-1,24%	1,23%	2,17%	0,77%	-0,75%	0,35%	0,68%	1,99%	0,33%	1,42%	10,37%	174%	68%	165%
2020	Vertex II	0,98%	-1,33%	-1,47%	1,72%	0,13%	0,27%	1,94%	-0,03%	-1,58%	0,27%	1,50%	1,45%	3,82%	139%	75%	165%
2021	Vertex II	-0,40%	-0,54%	1,40%	1,66%	0,36%	0,88%	0,44%	1,01%	-1,71%	3,36%	0,72%	0,99%	8,40%	190%	90%	173%
2022	Vertex II	0,49%	1,45%	5,32%	2,69%	1,41%	1,93%	-0,42%	3,78%	3,80%	0,17%	-0,24%	0,67%	23,00%	186%	133%	188%
2023	Vertex II	1,16%	-0,54%	0,69%	0,27%	1,44%	3,95%	2,41%	-0,51%	-0,97%	-0,76%	3,27%	3,14%	14,24%	109%	166%	179%
2024	Vertex II	0,87%	1,61%	0,31%	-1,57%	0,56%	1,71%	2,22%	1,21%	0,51%	-0,35%	2,35%	-0,50%	9,24%	85%	191%	168%
2025	Vertex II	0,35%	0,25%	0,14%	4,29%	0,01%	2,13%	-1,74%	1,19%	1,64%	0,50%	1,13%		10,22%	79%	221%	156%

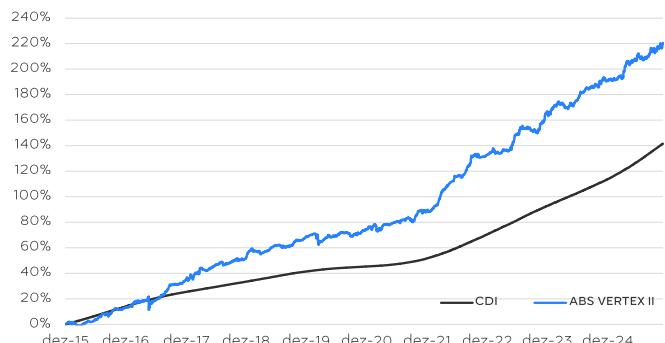
Data de início: 28/12/2015

ESTATÍSTICAS E PL

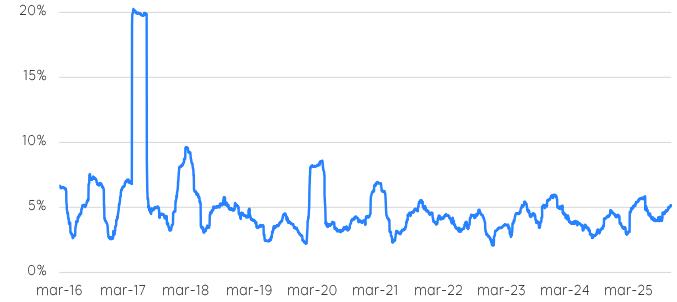
	Ano	Desde o início
Meses Positivos	10	94
Meses Negativos	1	26
Meses acima do CDI	5	65
Meses abaixo do CDI	6	55
Retorno máximo mensal	4,29%	5,32%
Retorno mínimo mensal	-1,74%	-1,74%
Volatilidade anualizada	4,61%	5,63%
Índice de Sharpe	-	1,08
VaR médio (% PL)	0,48%	0,61%
Stress médio (% PL)	6,10%	8,40%
Patrimônio líquido	Rs 2.635.519.315,69	
Patrimônio líquido médio (12m)	Rs 3.682.231.582,38	
Patrimônio líquido estratégia macro	Rs 25.037.405.577,08	

Categoria Anbima	Multimercado Macro
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 29 DC de antecedência (cotização em D+29 e liquidação em D+30)
Tx Adm	2% sendo mínima de 1,90% e máxima de 2,50%
Tx Performance	20% sobre o que exceder o CDI

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 R\$ 100.000

Movimentação R\$ 10.000

Saldo Mínimo R\$ 100.000

CNPJ | Código Anbidi 23.565.803/0001-99