

Absolute Vertex FIC FIM

Março 2024



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

Exclusivo.

RENTABILIDADE MENSAL

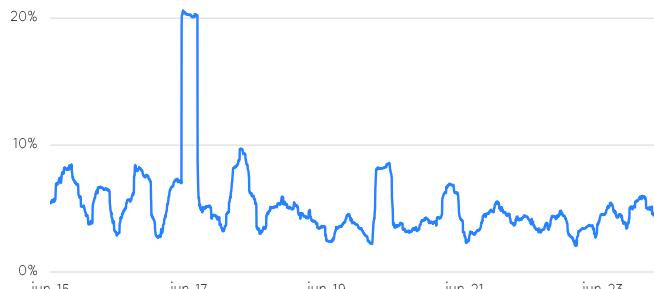
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	% CDI	Acum.	% CDI
2015 Vertex				0,86%	2,62%	0,15%	3,92%	3,16%	2,33%	-0,19%	1,32%	0,71%	15,62%	151%	16%	151%
2016 Vertex	0,95%	-0,31%	-1,65%	2,63%	0,34%	1,44%	3,35%	0,91%	0,77%	3,79%	-0,52%	1,05%	13,36%	95%	31%	120%
2017 Vertex	0,71%	2,79%	0,91%	0,40%	-1,43%	1,74%	2,93%	2,80%	4,08%	0,54%	0,33%	2,26%	19,49%	196%	57%	148%
2018 Vertex	2,35%	0,79%	3,65%	-1,42%	1,52%	1,31%	1,61%	-1,12%	1,13%	1,65%	0,22%	0,70%	12,99%	202%	77%	163%
2019 Vertex	4,48%	-1,39%	-1,24%	1,23%	2,17%	0,77%	-0,75%	0,35%	0,69%	2,02%	0,33%	1,42%	10,40%	174%	95%	170%
2020 Vertex	0,98%	-1,34%	-1,47%	1,72%	0,13%	0,27%	1,94%	-0,04%	-1,58%	0,27%	1,50%	1,45%	3,82%	138%	103%	171%
2021 Vertex	-0,40%	-0,54%	1,40%	1,66%	0,37%	0,88%	0,44%	1,01%	-1,71%	3,36%	0,72%	0,99%	8,40%	190%	120%	178%
2022 Vertex	0,49%	1,45%	5,32%	2,69%	1,41%	1,93%	-0,42%	3,78%	3,80%	0,17%	-0,25%	0,67%	22,98%	185%	170%	193%
2023 Vertex	1,16%	-0,54%	0,69%	0,27%	1,44%	3,95%	2,42%	-0,53%	-0,97%	-0,76%	3,27%	3,16%	14,26%	109%	209%	186%
2024 Vertex	0,86%	1,62%	0,31%										2,81%	107%	218%	184%

Data de início: 25/03/2015

ESTATÍSTICAS E PL

	Ano	Desde o inicio
Meses Positivos	3	85
Meses Negativos	0	24
Meses acima do CDI	1	61
Meses abaixo do CDI	2	48
Retorno máximo mensal	1,62%	5,32%
Retorno mínimo mensal	0,31%	-1,71%
Volatilidade anualizada	4,45%	5,99%
Índice de Sharpe	0,18	1,34
VaR médio (% PL)	0,82%	0,64%
Stress médio (% PL)	7,10%	9,18%
Patrimônio líquido	R\$ 3.525.231.017	
Patrimônio líquido médio (12m)	R\$ 3.082.318.356	
Patrimônio líquido estratégia macro	R\$ 31.072.777.131	

VOLATILIDADE [mm60d]



Categoria Anbima	Mutimercado Macro
Benchmark	CDI
Aplicação	Cotização e liquidação em D+0
Resgate	Cotização em D+1 e líq. 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 excede o CDI

Gestor	Absolute Gestão de Investimentos Ltda.
Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.
Distribuidor	Exclusivo
Custodiano	Banco BNY Mellon SA
Auditor	KPMG
Aplicação inicial	R\$ 100.000
Movimentação	R\$ 10.000
Saldo Mínimo	R\$ 10.000
CNPJ Código Anbida	21.470.989/0001-77

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