

OBJETIVO

O objetivo do fundo é gerar retornos absolutos e decorrelacionados, 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.

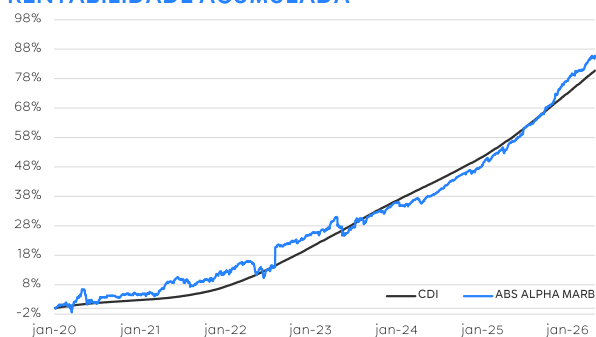
PÚBLICO ALVO

Investidores qualificados.

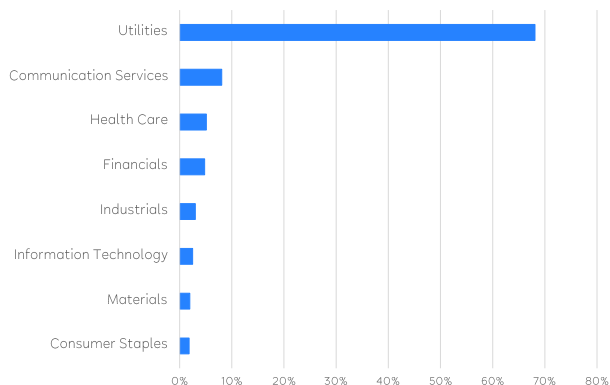
RENTABILIDADE MENSAL

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	% CDI	Acum.	% CDI
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%	167%	5%	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%	167%	12%	168%
2022 Alpha Marb	0,92%	1,42%	0,69%	-0,53%	-1,29%	-0,59%	0,65%	6,72%	0,60%	0,97%	0,01%	1,55%	11,46%	92%	25%	122%
2023 Alpha Marb	0,37%	0,43%	2,60%	-0,85%	-2,37%	1,91%	2,27%	-0,03%	1,33%	0,30%	1,20%	1,12%	8,48%	65%	36%	99%
2024 Alpha Marb	-0,70%	0,30%	1,46%	-0,64%	1,45%	0,87%	1,58%	1,31%	0,97%	0,88%	0,10%	1,11%	9,01%	83%	48%	94%
2025 Alpha Marb	1,29%	1,73%	1,18%	1,10%	0,94%	2,32%	0,92%	1,30%	1,73%	1,17%	2,84%	1,52%	19,59%	137%	77%	106%
2026 Alpha Marb	1,32%	0,73%	1,72%	1,05%									4,90%	108%	86%	106%

RENTABILIDADE ACUMULADA



EVENTOS POR SETOR [exposição]

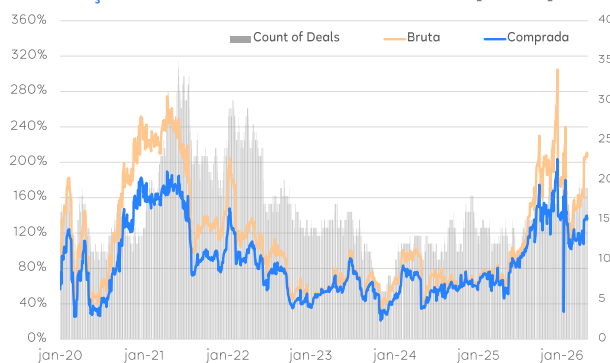


ESTATÍSTICAS E PL

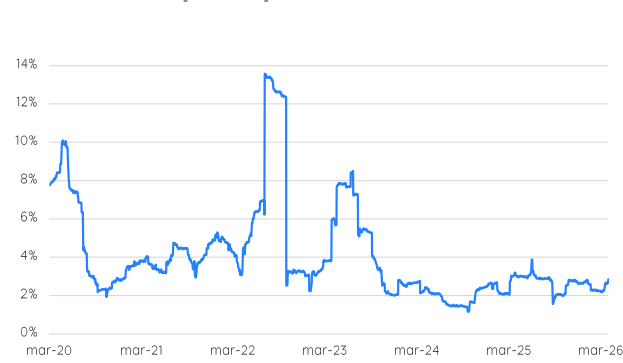
	Ano	Desde o início
Meses Positivos	4	60
Meses Negativos	0	16
Meses acima do CDI	2	41
Meses abaixo do CDI	2	35
Retorno máximo mensal	1,72%	6,72%
Retorno mínimo mensal	0,73%	-3,70%
Volatilidade anualizada	2,60%	4,75%
Índice de Sharpe	0,43	0,16
VaR médio (% PL)	2,75%	2,75%
Stress médio (% PL)	2,75%	2,75%
Patrimônio líquido	R\$	188.223.636,82
Patrimônio líquido médio (12m)	R\$	98.264.272,65
Patrimônio líquido estratégia arb	R\$	517.218.121,75

Data de início: 27/12/2019

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 caso opte pelo resgate D+1/D+2
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)