

BTG PACTUAL MAPFRE ABSOLUTO PREVIDÊNCIA FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

Perfil do Fundo
Público Alvo: Exclusivo, às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre - PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre - VGBL instituídos pela MAPFRE PREVIDÊNCIA S/A.
Objetivo: O FUNDO tem como objetivo obter ganhos de capital.
Política: Operações nos mercados de juros, câmbio, ações, commodities e dívida, utilizando-se dos instrumentos disponíveis tanto nos mercados à vista quanto nos mercados de derivativos. O FUNDO poderá se utilizar, entre outros, de mecanismos de hedge, operações de arbitragem e alavancagem para alcançar seus objetivos. A exposição do FUNDO dependerá, entre outros fatores, da liquidez e volatilidade dos mercados em que estiver atuando.

Informações Gerais	
CNPJ	37.978.642/0001-70
Início do fundo	06/07/2021
Código Anbima	600776
Classificação Anbima	Previdência Multimercado Livre
Gestão	BTG Pactual Dtm
Custodiante	Banco BTG Pactual
Administrador	BTG Pactual Serviços Financeiros Dtm
Aplicação	D+0
Resgate	D+7
Pagamento	D+9
Aplicação inicial	R\$ 0,00
Movimentação mínima	R\$ 0,00
Taxa de administração	Mín de 1 % Máx de 2 %
Taxa de performance	0 %
Patrimônio líquido	R\$ 2.768.630,17
Patrimônio médio em 12 meses	R\$ 4.285.532,59

Período da Análise: 06/07/2021 a 28/03/2024. Retornos em %.

Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Fev 2024	Jan 2024	Dez 2023	Nov 2023	Out 2023	Set 2023	Ago 2023	Jul 2023	Jun 2023	Mai 2023	Abr 2023
Fundo	-2,62	14,83	-3,12		0,36	0,01	-2,97	3,36	7,92	-3,11	0,21	-5,11	2,14	7,11	5,55	-1,16
CDI	2,62	12,46	27,39	35,51	0,83	0,80	0,97	0,89	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92
Percent CDI	-99,77	118,98	-11,38		43,11	1,53	-307,74	376,06	864,91	-311,40	21,47	-449,01	199,93	663,65	494,08	-126,15
IBOV	-4,53	25,85	6,74	10,99	-0,71	0,99	-4,79	5,38	12,54	-2,94	0,71	-5,09	3,26	9,00	3,74	2,50
OURO	20,77	7,19	18,07	9,27	10,65	1,64	7,39	-0,98	-2,85	-0,99	-2,57	4,08	-0,17	-6,21	0,00	-0,95
POUPANCA1	1,64	7,60	16,54	21,59	0,53	0,51	0,59	0,57	0,58	0,61	0,61	0,72	0,66	0,68	0,72	0,58

Indicadores de Performance.

Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Fev 2024	Jan 2024	Dez 2023	Nov 2023	Out 2023	Set 2023	Ago 2023	Jul 2023	Jun 2023	Mai 2023	Abr 2023
VaR (%)	4,12	5,64	7,22		3,16	4,37	4,85	4,60	5,36	7,74	6,08	5,05	5,33	6,08	5,78	6,80
Volatilidade (%)	8,68	11,88	15,19		6,65	9,20	10,21	9,68	11,28	16,30	12,81	10,64	11,22	12,80	12,18	14,32
Índice de Sharpe	-2,45	0,24	-0,79	-1,12	-2,30	-1,09	-4,42	3,19	7,57	-2,97	-0,69	-6,51	1,18	5,51	4,09	-1,97



Quadro Estatístico	
Meses com retorno positivo:	15
Maior retorno mensal:	8,71% (Jul/2022)
Meses com retorno negativo:	18
Menor retorno mensal:	-12,62% (Out/2021)
Retorno acumulado:	-27,23%
Retorno acumulado benchmark:	34,31%
Meses acima do benchmark:	11
Meses abaixo do benchmark:	22

