

Estratégia	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	Mai	Jun	2022	Since Inception
Arbitragem linear	0,45%	0,33%	0,34%	0,23%	0,22%	0,33%	0,36%	0,04%	0,02%	0,30%	2,64%
Arbitragem não-linear	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Long-Short	-0,06%	0,01%	0,03%	-0,03%	0,15%	-0,02%	0,17%	0,01%	-0,03%	0,02%	0,22%
Eventos corporativos	3,04%	3,44%	3,01%	5,28%	2,21%	1,19%	1,47%	-0,60%	-0,41%	-0,96%	20,91%
Local	2,93%	0,91%	2,03%	2,82%	0,30%	0,43%	0,49%	0,03%	0,07%	0,11%	11,16%
Offshore	0,11%	2,51%	0,96%	2,39%	1,90%	0,75%	0,98%	-0,62%	-0,48%	-1,07%	8,77%
Direcional com assimetria	1,14%	11,01%	4,88%	0,86%	3,12%	0,39%	0,37%	-0,15%	-0,19%	-0,31%	21,86%
Local	1,18%	9,52%	3,78%	0,82%	2,49%	0,38%	0,37%	-0,15%	-0,19%	-0,31%	18,15%
Offshore	-0,03%	1,37%	1,06%	0,03%	0,61%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	3,15%
Caixa	7,81%	12,88%	8,89%	5,79%	5,65%	2,25%	4,29%	1,03%	0,99%	5,33%	66,36%
Taxas e custos	-2,93%	-5,69%	-3,60%	-2,72%	-2,74%	-1,99%	-2,03%	-0,19%	-0,16%	-0,98%	-20,51%
Absolute Alpha Global	9,49%	22,62%	13,81%	9,48%	8,70%	2,13%	4,62%	0,14%	0,21%	3,32%	100,73%
CDI	8,05%	14,00%	9,93%	6,42%	5,96%	2,75%	4,42%	1,03%	1,02%	5,42%	72,59%
% CDI	118%	162%	139%	148%	146%	77%	104%	14%	20%	61%	139%

P & L e POSIÇÕES ATUAIS

Arbitragem Linear

Ganho de 2 bps na carteira de termo.

Principais posições atuais:

17% carteira de termo

Long & Short

Perda de 3 bps.

Principais posições atuais:

1,6% PETR3 x PETR4

1,2% USIM3 x USIM5

1,2% BBDC3 x BBDC4

Direcional com Assimetria

O livro teve contribuição negativa, com destaque negativo para a posição de GPS.

Principais posições atuais:

0,7% bruto (2 posições)

Eventos Corporativos

O livro de *merger arb offshore* apurou 48 bps de perda com destaque negativo para as operações de Vonage/Ericsson (-17 bps), Citrix/Vista PE (-7 bps) e Anaplan/ThomaBravo (-6 bps). O destaque positivo foi a operação de Avast/Norton LifeLock (13 bps) e New York Community Bancorp/Flagstar Bancorp (2 bps).

O livro local gerou 7 bps de ganho, com destaque positivo para a operação de Localiza/Unidas.

Principais posições atuais:

16,0% alocado em eventos corporativos offshore

(12 posições, destaques: NY Community Bancorp/Flagstar Bancorp, Avast/Norton e SailPoint/ThomaBravo)

0,6% alocado em eventos corporativos locais (3 posições)

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 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 obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo dos fundos. O fundo Absolute Pace buscará manter seus investimentos em ativos financeiros de renda variável, com o objetivo de proporcionar aos seus cotistas tratamento tributário aplicável aos fundos de renda variável. Para os demais fundos, não há garantia de que o fundo terá tratamento tributário para fundos de longo prazo. "PL Médio" é a média aritmética do patrimônio líquido do fundo nos últimos 12 meses ou desde sua constituição, se mais recente. Os retornos para o MÊS, ANO, 12 MESES e DESDE O INÍCIO, são as rentabilidades apuradas diariamente do período citado até a data constante nesse material. Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. (CNPJ: 02.201.501/0001-61), Av. Presidente Wilson, 231 - 11º andar, Rio de Janeiro, RJ, CEP 20030-905. Telefone: (21) 3219-2500 www.bnymellon.com.br/sf SAC: sac@bnymellon.com.br ou (21) 3219-2600, (11) 3050-8010, 0800 725 3219 Ouvidoria: ouvidoria@bnymellon.com.br.

