

BRESSER HEDGE FIM

Julho / 2019

Rentabilidade %													Acumulado		
Período	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	CDI	% CDI
2019	1,8%	-0,8%	0,1%	0,6%	2,1%	1,3%	1,8%						7,2%	3,7%	196,2%
2018	2,1%	-0,1%	0,1%	-0,6%	-0,1%	0,8%	0,9%	-0,4%	0,7%	1,6%	0,8%	1,5%	7,5%	6,4%	117,4%
2017	2,8%	4,2%	-1,0%	1,2%	-2,3%	0,3%	3,8%	3,8%	1,2%	-1,7%	-0,3%	1,7%	14,4%	9,9%	144,6%
2016	2,7%	-0,4%	3,3%	2,0%	-0,1%	1,4%	1,5%	0,4%	0,7%	4,2%	-1,2%	-0,3%	15,1%	14,0%	108,0%
2015	0,1%	0,3%	2,0%	-0,2%	0,8%	0,3%	2,3%	0,9%	2,1%	-0,9%	0,4%	1,0%	9,7%	13,2%	73,0%
2014	-0,6%	0,7%	0,9%	1,2%	1,4%	1,8%	-0,4%	1,6%	1,1%	-0,3%	0,4%	1,1%	9,3%	10,8%	85,8%
2013	1,0%	-0,1%	-0,6%	0,4%	0,1%	0,0%	0,5%	1,4%	-0,3%	0,8%	0,0%	1,1%	4,6%	8,1%	57,5%
2012	0,4%	2,7%	2,3%	2,8%	0,6%	1,2%	0,6%	0,7%	0,8%	1,8%	1,4%	0,4%	17,0%	8,4%	202,6%
2011	-0,1%	-0,1%	2,2%	2,5%	0,9%	0,4%	-0,2%	2,4%	1,3%	-0,2%	1,5%	0,5%	11,7%	11,6%	101,3%
2010	1,3%	-0,1%	0,9%	0,2%	-0,3%	0,7%	1,8%	1,3%	0,9%	2,0%	0,8%	0,5%	10,2%	9,8%	105,0%
2009	0,5%	0,5%	1,8%	3,4%	2,2%	0,6%	2,3%	1,2%	2,1%	0,9%	1,6%	0,7%	19,2%	9,9%	194,4%
2008	0,2%	0,4%	-0,4%	0,6%	1,3%	0,9%	-0,9%	-0,1%	-0,7%	-0,4%	0,4%	1,8%	3,1%	12,4%	25,2%
2007	1,8%	0,5%	1,3%	1,7%	1,6%	1,3%	1,0%	1,3%	0,5%	0,5%	0,8%	0,2%	13,1%	11,8%	111,0%
2006	4,3%	2,2%	0,1%	3,2%	-0,8%	1,0%	1,2%	1,8%	0,9%	1,6%	1,7%	2,6%	21,9%	15,0%	145,7%
2005	1,6%	2,7%	0,5%	0,9%	1,2%	1,9%	1,4%	1,3%	3,5%	0,4%	1,7%	1,0%	19,5%	19,0%	102,4%
2004	1,3%	0,0%	1,4%	1,2%	1,0%	1,2%	2,0%	3,1%	2,3%	0,9%	1,3%	2,6%	19,9%	16,2%	123,3%
2003	2,0%	2,1%	1,7%	2,1%	2,0%	1,2%	2,0%	3,4%	2,7%	2,9%	3,0%	3,6%	32,9%	23,2%	141,6%

Performance Acumulada

	Ano	12 meses	36 meses	60 meses	Desde início	Retorno Anualiz.	PL atual (R\$)	PL médio 12 meses (R\$)
Bresser Hedge FIM	7,2%	11,7%	36,9%	72,9%	810,9%	14,1%	21.482.796	52.208.258
CDI	3,7%	6,3%	28,2%	63,7%	596,0%	12,3%		
% do CDI	196,2%	184,0%	130,9%	114,4%	136,1%			

Total de Ativos sob Gestão (R\$)

600 milhões

Composição da Carteira

Consumo Cíclico	11,8%
Utilidade Pública	10,9%
Consumo não Cíclico	7,9%
Construção e Transporte	4,9%
Materiais Básicos	2,3%
Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1,7%
Serviços Financeiros	0,9%
Outros	0,0%
Total	40,3%

Valor de Mercado (R\$)

> 10bi	37,7%
3bi - 10bi	2,5%
1bi - 3bi	0,0%
< 1bi	0,0%

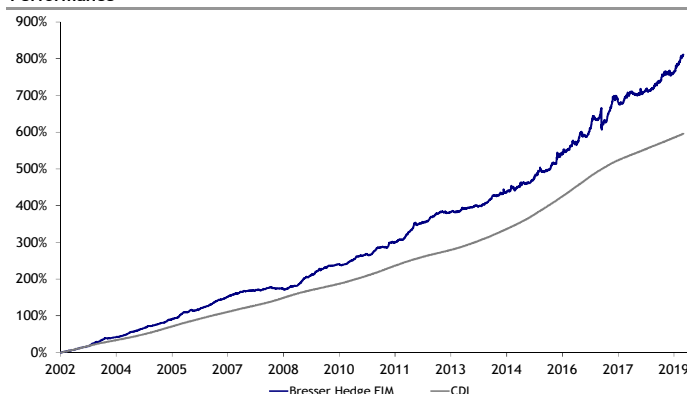
Perfil de Liquidez - Volume Diário

> R\$ 10 mi	40,3%
R\$1mi - 10mi	0,0%
< R\$ 1 mi	0,0%

Exposição Long & Short

Long	Short	Net Long
47,7%	-7,5%	40,3%

Performance



Concentração

10 Maiores Posições	34,1%
Maior Posição	5,9%

Características do Fundo

Objetivo: O fundo tem como política de investimento aplicar seus recursos em títulos e valores mobiliários e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. O fundo aplica com flexibilidade nos mercados de Renda Fixa, Renda Variável e derivativos, com objetivo de atingir uma rentabilidade superior à do Certificado de Depósito Interbancário (CDI), em um horizonte de investimento de médio a longo prazo.

Tipo/Classe: Fundo de Investimento Multimercado

Categoria ANBIMA: Fundo Multimercado Multiestratégia

Público Alvo: Investidores em geral que buscam obter retorno compatível com os objetivos da política de investimento do fundo

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S/A.

Gestora: Bresser Administração de Recursos

Auditoria: Price Waterhouse Coopers

Divulgação: Jornal Valor Econômico(*)

Data de Início: 31/10/2002

Taxa de Adm.: 2% a.a., provisionada diariamente e paga mensalmente.

Taxa de Performance: 20% sobre o que exceder a 100% do CDI

Aplicação: D+0 (pelo valor da cota do dia útil da efetiva disponibilidade dos recursos).

Resgate: Conversão D+5 / Pagamento D+6 (dias úteis)

Taxa de saída: 10%. O investidor estará isento da taxa de saída desde que solicite resgate com antecedência de 5 dias úteis à data de conversão.

Horário de aplicação/resgate: Até às 14h

Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00

Movimentação Mínima: R\$ 10.000,00

Saldo Mínimo: R\$ 2.000,00

IR: Alíquota varia de 22,5% a 15% dependendo do momento do resgate. O IR é retido na fonte no último dia útil dos meses de maio e novembro e/ou no momento do resgate. "Come-cotas" recolhido à alíquota de 15%. Alíquota complementar recolhida no momento do resgate, se aplicável. A quantidade de cotas será reduzida no valor correspondente ao imposto devido

IOF: Alíquota de 1% a.d. sobre o valor do resgate, limitada a uma porcentagem do rendimento da operação, em função do prazo, conforme tabela decrescente, de acordo com a regulamentação em vigor.

Dados Bancários:

BNY Mellon Banco S.A (017) / Agência: 001 C/C: 823-0

CNPJ: 05.097.427/0001-73

Para mais informações: contato@bresserasset.com.br | www.bresserasset.com.br | Tel.: + 55 11 3706-0000

Fundos de Investimentos não contam com a garantia do administrador do fundo, da gestora da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do fundo garantidor de créditos - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor, é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e nem de taxas de saída. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Este fundo utiliza 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. A Bresser Administração de Recursos Ltda. não comercializa nem distribui quotas de fundos de investimento ou qualquer outro ativo financeiro. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Os fundos de ações podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. "IBOVESPA" é mera referência econômica, e não meta ou parâmetro de performance do fundo. As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Contato administrador/distribuidor: Av. Presidente Wilson nº231, 11º andar - Rio de Janeiro, RJ, CEP 20030-905. Fone: (021)3219-2998. E-mail: sac@bnymellon.com.br; ouvidoria@bnymellon.com.br



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.