BRESSER asset management

## BRESSER HEDGE PLUS FIM — Março / 2019

**Rentabilidade %**

| Período | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Acumulado Ano | CDI | % CDI |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2019 | 2,5% | -1,4% | -0,1% | | | | | | | | | | 1,0% | 1,5% | 68,2% |
| 2018 | 3,1% | -0,1% | 0,1% | -0,9% | -0,3% | 1,2% | 1,4% | -0,8% | 0,9% | 2,3% | 1,1% | 2,1% | 10,2% | 6,4% | 159,3% |
| 2017 | 3,8% | 5,7% | -1,5% | 1,4% | -4,2% | 0,0% | 5,4% | 5,0% | 1,4% | -2,2% | -0,7% | 2,5% | 17,2% | 9,9% | 173,5% |
| 2016 | 3,6% | -1,2% | 4,5% | 2,5% | -0,6% | 1,5% | 1,8% | 0,2% | 0,7% | 5,8% | -2,0% | -0,7% | 16,9% | 14,0% | 120,9% |
| 2015 | -0,2% | 0,2% | 2,4% | -0,7% | 0,9% | 0,0% | 3,0% | 1,0% | 2,7% | -1,9% | 0,2% | 1,0% | 8,8% | 13,2% | 66,5% |
| 2014 | -1,2% | 0,8% | 1,0% | 1,4% | 1,8% | 2,2% | -1,2% | 2,7% | 0,8% | -0,4% | 0,2% | 1,2% | 9,6% | 10,8% | 88,4% |
| 2013 | 1,5% | -0,2% | -1,0% | 0,4% | 0,0% | -0,2% | 0,5% | 2,0% | -0,7% | 0,9% | -0,3% | 1,3% | 4,1% | 8,1% | 51,0% |
| 2012 | 0,3% | 3,5% | 3,2% | 3,8% | 0,7% | 1,4% | 0,7% | 0,7% | 0,7% | 2,4% | 1,5% | 0,3% | 20,9% | 8,4% | 248,6% |
| 2011 | -0,5% | -0,5% | 2,9% | 3,1% | 0,9% | 0,3% | -0,7% | 3,0% | 1,5% | -0,5% | 1,8% | 0,3% | 12,2% | 11,6% | 105,4% |
| 2010 | 1,6% | -0,2% | 1,0% | 0,1% | -0,9% | 0,6% | 2,2% | 1,5% | 1,0% | 2,3% | 1,0% | 0,4% | 11,1% | 9,8% | 114,2% |
| 2009 | 0,2% | 0,4% | 2,2% | 4,6% | 2,7% | 0,5% | 3,0% | 1,6% | 2,7% | 1,2% | 2,0% | 0,8% | 24,3% | 9,9% | 245,4% |
| 2008 | -0,4% | 0,1% | -1,4% | 0,5% | 1,4% | 0,9% | -1,6% | -0,4% | -1,3% | -1,1% | 0,7% | 2,3% | -0,4% | 12,4% | - |
| 2007 | | | | 1,6% | 2,3% | 1,8% | 1,2% | 1,8% | 0,3% | 0,2% | 1,0% | -0,5% | 10,3% | 8,1% | 126,8% |

**Performance Acumulada**

| | Ano | 12 meses | 36 meses | 60 meses | Desde início | Retorno Anualiz. | PL atual (R$) | PL médio 12 meses (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Bresser Hedge Plus | 1,0% | 8,1% | 41,5% | 82,1% | 289,9% | 12,0% | 28.411.122 | 27.037.559 |
| CDI | 1,5% | 6,3% | 31,3% | 66,0% | 225,4% | 10,4% | | |
| % do CDI | 68,2% | 128,0% | 132,7% | 124,5% | 128,6% | | | |

**Total de Ativos sob Gestão (R$)** — **595 milhões**

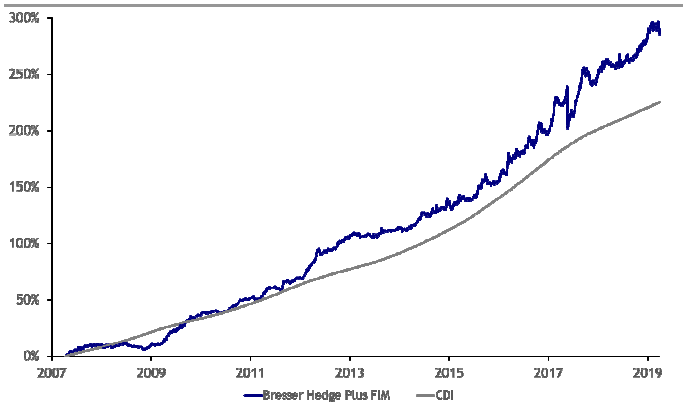
**Composição da Carteira**

| | |
|---|---|
| Materiais Básicos | 5,7% |
| Serviços Financeiros | 4,9% |
| Utilidade Pública | 2,7% |
| Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 2,5% |
| Consumo não Cíclico | 2,3% |
| Consumo Cíclico | 1,1% |
| Construção e Transporte | -1,3% |
| Outros | 0,0% |
| Total | 17,8% |

**Valor de Mercado (R$)**

| | |
|---|---|
| > 10bi | 20,9% |
| 3bi - 10bi | -0,6% |
| 1bi - 3bi | -2,7% |
| < 1bi | 0,2% |

**Performance**




**Perfil de Liquidez - Volume Diário**

| | |
|---|---|
| > R$ 10 mi | 20,3% |
| R$1mi - 10mi | -2,5% |
| < R$ 1 mi | 0,0% |

**Exposição Long & Short**

| Long | Short | Net Long |
|---|---|---|
| 29,7% | -11,9% | 17,8% |

**Concentração**

| | |
|---|---|
| 10 Maiores Posições | 24,6% |
| Maior Posição | 3,8% |

### Características do Fundo

**Objetivo:** Aplicar os recursos em títulos e valores mobiliários e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, utilizando-se da análise do cenário macro econômico do país, da análise dos fundamentos específicos de cada setor e empresa, e de uma avaliação do preço de cada ativo, de modo a assumir posições de direcionais e de arbitragem nos ativos, com expectativa de retorno em curto, médio e longo prazo de modo a maximizar os retornos obtidos, dentro dos parâmetros de risco definidos pelo gestor, com o objetivo de atingir uma rentabilidade superior ao do CDI.

**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:** KPMG

**Divulgação:** Jornal Valor Econômico(*)

**Data de Início:** 12/04/2007

**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+7 / Pagamento D+8 (dias úteis)

**Taxa de saída:** 10%. O investidor estará isento da taxa de saída desde que solicite resgate com antecedência de 7 dias úteis à data de conversão.

**Horário de aplicação/resgate:** Até as 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 percentagem 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: 822-2

CNPJ: 08.739.850/0001-18

**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, 11˚andar - Rio de Janeiro,RJ, CEP 20030-905. Fone: (021)3219-2998. E-mail: sac@bnymellon.com.br; ouvidoria@bnymellon.com.br

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