

Objetivo

O fundo tem por objetivo buscar retorno aos seus cotistas através de investimentos em ativos financeiros disponíveis no mercado de renda fixa e derivativos, exclusivamente para fins de hedge até 1 (uma) vez o seu patrimônio líquido, negociados no mercado interno, sendo vedada exposição à renda variável, cambial e alavancagem.

Política de Investimentos

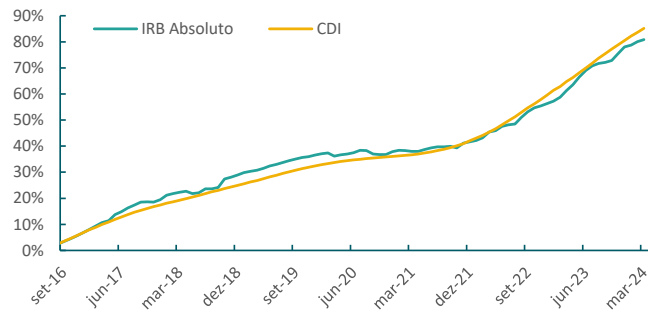
Possuir concentração mínima de 80% da carteira em ativos relacionados direta ou sintetizados via derivativos a fatores de risco vinculados a taxa de juros pós-fixadas, taxa de juros pré-fixadas, índices de preços e derivativos, exclusivamente para fins de hedge até 1 (uma) vez o seu patrimônio líquido.

Rentabilidade

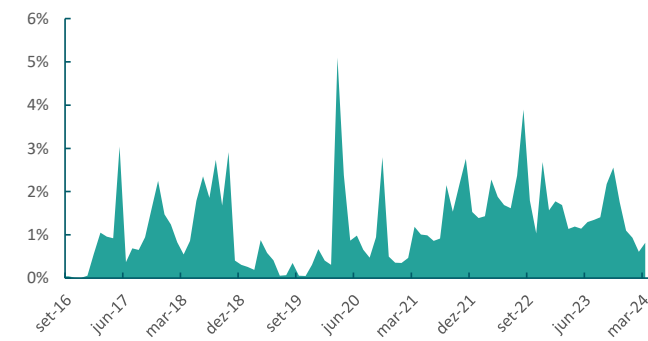
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Início
2024	0,41%	0,70%	0,45%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,56%	80,84%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,62%	85,17%
%CDI	42%	88%	54%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	60%	95%
2023	0,58%	0,95%	1,63%	1,38%	1,80%	1,55%	1,03%	0,48%	0,25%	0,44%	1,53%	1,46%	13,87%	78,06%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%	80,43%
%CDI	52%	103%	139%	150%	160%	144%	96%	42%	25%	44%	167%	163%	106%	97%
2022	0,37%	0,72%	1,54%	0,38%	1,09%	0,40%	0,22%	1,74%	1,44%	0,95%	0,50%	0,60%	10,39%	56,37%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,37%	59,61%
%CDI	51%	96%	166%	46%	106%	39%	21%	149%	134%	93%	49%	53%	84%	95%
2021	0,36%	-0,11%	-0,23%	0,00%	0,57%	0,42%	0,32%	-0,01%	0,11%	-0,40%	1,32%	0,35%	2,72%	41,66%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,40%	42,03%
%CDI	242%	-	-	1%	211%	137%	91%	-	24%	-	225%	45%	62%	99%
2020	0,32%	0,29%	-0,91%	0,33%	0,24%	0,37%	0,71%	-0,11%	-0,92%	-0,20%	0,04%	0,81%	0,97%	37,91%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%	36,05%
%CDI	86%	97%	-	117%	100%	171%	364%	-	-	-	30%	491%	35%	105%
2019	0,70%	0,40%	0,34%	0,54%	0,70%	0,47%	0,52%	0,51%	0,46%	0,46%	0,19%	0,49%	5,93%	36,59%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	32,39%
%CDI	129%	81%	72%	105%	128%	99%	92%	101%	98%	97%	49%	131%	99%	113%

Estatísticas

Indicadores	12m	24m	Início
Rentabilidade acumulada	12,08%	24,37%	80,84%
Volatilidade anualizada	1,50%	1,84%	1,61%
Índice Sharpe	-0,19	-1,12	-0,96
PL médio (BRL MM)	1.590	1.598	2.107
N° meses positivos	12	24	82
N° meses negativos	0	0	11
N° meses acima CDI	5	10	40
N° meses abaixo CDI	7	14	53
Maior rentabilidade	1,80%	1,80%	2,67%
Menor rentabilidade	0,25%	0,22%	-0,92%

Rentabilidade acumulada

Principais características

Data de início do fundo	01/07/2016
Patrimônio líquido	R\$ 1.662.993.203
Investimento mínimo	R\$ 10.000.000
Movimentação mínima	Não há
Cota aplicações	D+0
Cota resgate	D+0
Liquidação resgate	D+0
Taxa de administração	0,50% a.a
Taxa de performance	20% do que exceder CDI
Público Alvo	Investidor profissional
Classificação ANBIMA	Renda Fixa
Código ANBIMA	422584
Código ISIN	BRIRB6CTF001
Ticker Bloomberg	IRBABST BZ <Equity>

Volatilidade (21 dias anualizada)

Outras características

Gestor	IRB Asset Management
Administrador	BEM DTVM LTDA
Custodiante	Banco Bradesco S.A.
Auditor Independente	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA


Contatos

e-mail	contato@irbasset.com
Site	www.irbasset.com

Esse documento foi elaborado pela IRB Asset Management e é de caráter exclusivamente informativo. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS E DA TAXA DE SAÍDA. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DOS GESTORES, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA DISPONÍVEL NO FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES.



Telefone:
 (21) 2272-0695


Av. República do Chile, 330 - 4º andar
 Rio de Janeiro - RJ - 20030-170