Material de divulgação

BTG Pactual Hedge FI Multimercado

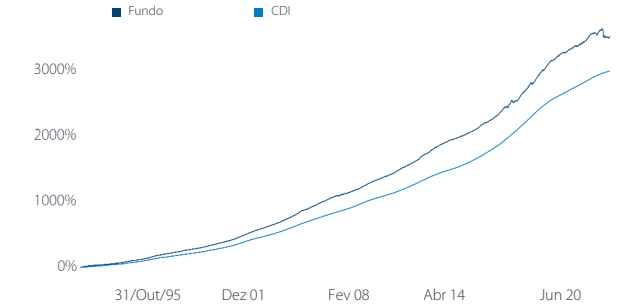
Multimercado

Rentabilidade (%) em R$

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum. Ano	Acum. Fundo
2016														
% Fundo	0,89	0,28	0,84	1,72	1,31	0,79	1,36	0,98	1,50	1,21	-0,12	1,08	12,49	2.840,05
% CDI	84,08	28,16	72,74	162,90	118,23	68,41	122,43	80,95	135,62	115,86	-	95,77	89,19	120,74
2017														
% Fundo	1,57	1,30	1,21	0,92	0,66	0,95	1,40	1,01	0,94	0,40	0,41	0,77	12,16	3.197,43
% CDI	144,71	149,87	115,42	116,11	71,03	116,76	174,76	125,83	146,90	61,27	72,80	142,62	122,14	123,16
2018														
% Fundo	0,90	0,44	0,65	0,54	-0,31	0,63	0,72	0,37	0,47	0,73	0,31	-0,31	5,23	3.370,04
% CDI	153,80	95,42	121,59	103,65	-	121,92	132,61	64,46	100,16	134,22	61,93	-	81,50	121,69
2019														
% Fundo	0,90	0,39	0,42	0,48	0,72	0,98	0,94	0,71	0,01	0,12	-0,67	1,46	6,65	3.600,71
% CDI	165,75	79,52	90,32	93,51	132,12	208,59	165,48	141,43	2,47	25,40	-	387,85	111,39	122,45
2020														
% Fundo	0,39	0,07	-2,19	-0,72	-0,26	0,50							-2,20	3.519,30
% CDI	104,78	24,57	-	-	-	232,52							-	117,53

Líquida de taxa de administração e performance, porém não líquida de impostos devidos. Início das atividades em 31/Out/1995. Patrimônio médio em 12 meses: R$ 39,31 MM.

Performance - Dados atualizados até 30/06/20



Atribuição de Performance

Juros Brasil	0,04%
Juros ex-Brasil	0,06%
Câmbio	-0,01%
Bolsa Brasil	-0,03%
Bolsa Global	-0,04%
Crédito Privado	0,37%
Caixa	0,22%
Custos	-0,11%
Total	**0,50%**

Composição do Fundo

A pagar / receber Bolsa	-0,10%
Ações	2,76%
Ajuste Swap e BM&F	0,17%
Fundo Investido	5,39%
Fundo Investido - Exterior	13,60%
Oper. Compromissada	9,76%
Títulos Privados	48,32%
Títulos Públicos	20,10%

Perfil Risco x Retorno (R$)

	Desde Início		Últimos 12 meses	
	Fundo	CDI	Fundo	CDI
Retorno Anualizado	15,73%	15,00%	0,33%	4,62%
Desvio Padrão Anualizado	2,16%	0,41%	2,44%	0,07%
Índice de Sharpe[1]	0,34	-	-1,76	-
# de meses abaixo de 100% do CDI	112	-	7	-
# de meses acima de 100% do CDI	183	-	5	-
Maior rentabilidade mensal	5,30%	3,28%	1,46%	0,57%
Menor rentabilidade mensal	-2,19%	0,22%	-2,19%	0,22%

[1] A taxa livre de risco utilizada é o CDI

Patrimônio: R$ 32,02 MM

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

Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor 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. É recomendada a leitura cuidadosa do regulamento, do formulário de informações complementares e da lâmina de informações essenciais pelo investidor ao aplicar seus recursos. Os investidores devem estar preparados para aceitar os riscos inerentes aos diversos mercados em que os fundos atuam e, conseqüentemente, possíveis variações no patrimônio investido.

BTG Pactual Hedge FI Multimercado

Multimercado

Características Principais

Código Anbima: 022780

CNPJ: 00.888.897/0001-31

ISIN: BRPCHECTF009

Objetivo do Fundo

O FUNDO tem como objetivo obter ganhos de capital através de operações nos mercados de juros, câmbio, commodities e dívida, utilizando-se dos instrumentos disponíveis tanto nos mercados à vista quanto nos mercados de derivativos, propiciando aos quotistas uma performance superior aos instrumentos tradicionais de renda fixa.

Classificação ANBIMA

Multimercado livre

Administrador

BTG Pactual Servicos Financeiros S/A DTVM

Gestor

BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM

Movimentações

INICIAL: R$ 1.000,00;
MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA: R$ 1.000,00;
SALDO MÍNIMO: R$ 1.000,00

Público Alvo

O FUNDO destina-se a receber aplicações de recursos provenientes exclusivamente de investidores pessoas físicas e jurídicas em geral que busquem performance diferenciada e entendam a natureza e a extensão dos riscos envolvidos.

Taxa de Administração

1,50% A.A. SOBRE O PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO, APROPRIADA DIARIAMENTE NO VALOR DA QUOTA.
ESSA TAXA PODERÁ SER ACRESCIDA DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO EM QUE O FUNDO INVISTA, PODENDO ATINGIR A PERCENTAGEM MÁXIMA DE 2,50% A.A.

Prêmio de Performance

20% SOBRE A RENTABILIDADE QUE EXCEDER 100% DO CDI NO PERÍODO, APROPRIADO DIARIAMENTE

NO VALOR DA QUOTA.

I.R.

RETIDO NA FONTE, SEMESTRALMENTE, NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DOS MESES DE MAIO E NOVEMBRO, APLICANDO-SE A ALÍQUOTA DE 15%. NO RESGATE É APLICADA A ALÍQUOTA COMPLEMENTAR, EM FUNÇÃO DO PRAZO DA APLICAÇÃO, CONFORME DESCRITO ABAIXO:

I - 22,5% EM APLICAÇÕES COM PRAZO DE ATÉ 180 DIAS;
II - 20% EM APLICAÇÕES COM PRAZO DE 181 DIAS ATÉ 360 DIAS;
III - 17,5% EM APLICAÇÕES COM PRAZO DE 361 DIAS ATÉ 720 DIAS;
IV - 15% EM APLICAÇÕES COM PRAZO ACIMA DE 720 DIAS.

NÃO HÁ GARANTIA DE QUE ESTE FUNDO TERÁ O TRATAMENTO TRIBUTÁRIO PARA FUNDOS DE LONGO PRAZO.

Carência

LIQUIDEZ DIÁRIA.

Aplicações

CHEQUE OU DOC: ATÉ ÀS 15:40H. TED: ATÉ ÀS 15:40H, MEDIANTE CONSULTA À ADMINISTRADORA.
QUOTA DE D+0 DIAS ÚTEIS DA EFETIVA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS.

Resgates

CHEQUE OU DOC: ATÉ ÀS 15:40. TED: ATÉ ÀS 15:40, MEDIANTE CONSULTA À ADMINISTRADORA.
QUOTA DE D+0 DIAS ÚTEIS, RECURSOS EM D+1 DIAS ÚTEIS.

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 quotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado, implicando na ocorrência de patrimônio líquido do Fundo e a conseqüente obrigação do quotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do Fundo.

Este Fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

O Regulamento e a Lâmina de informações essenciais do fundo podem ser encontrados no site:
https://www.btgpactual.com/home/AssetManagement.aspx/AdministracaoFiduciaria

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

Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor 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. É recomendada a leitura cuidadosa do regulamento, do formulário de informações complementares e da lâmina de informações essenciais pelo investidor ao aplicar seus recursos. Os investidores devem estar preparados para aceitar os riscos inerentes aos diversos mercados em que os fundos atuam e, conseqüentemente, possíveis variações no patrimônio investido.

Ouvidoria 0800 722 00 48 / SAC 0800 722 2827