

MAPFRE HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA PREV

Perfil do Fundo
Público Alvo: Restrito, a sociedades: seguradoras, de capitalização e entidades abertas de previdência complementar, todos investidores profissionais.
Objetivo: O FUNDO tem por objetivo proporcionar aos seus Cotistas rentabilidade.
Política: Mínimo de 80% do patrimônio líquido do FUNDO deve ser investido em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa, relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à variação de taxa de juros, de índice de preço, ou ambos (pós ou pré-fixados).

Informações Gerais	
CNPJ	12.124.044/0001-02
Início do fundo	17/11/2011
Código Anbima	291129
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Gestão	Mapfre Invest.
Custodiante	Banco BNP Paribas Brasil
Administrador	Banco BNP Paribas Brasil
Aplicação	D+0
Resgate	D+0
Pagamento	D+0
Aplicação inicial	
Movimentação mínima	
Taxa de administração	1,5 %
Taxa de performance	0 %
Patrimônio líquido	R\$ 360.745.608,91
Patrimônio médio em 12 meses	R\$ 352.604.557,10

Período da Análise: 17/11/2011 a 30/09/2021. Retornos em %.

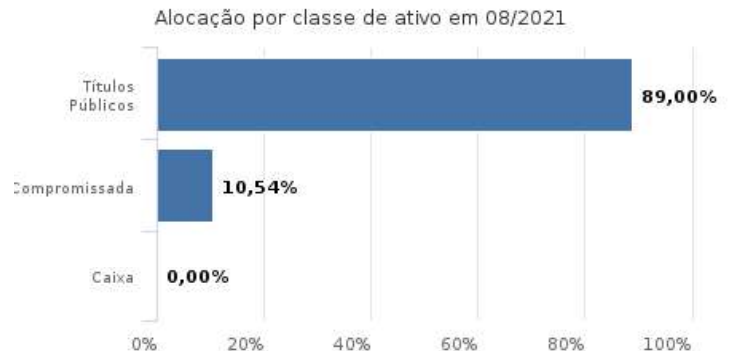
Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Ago 2021	Jul 2021	Jun 2021	Mai 2021	Abr 2021	Mar 2021	Fev 2021	Jan 2021	Dez 2020	Nov 2020	Out 2020
Fundo	-5,50	2,79	14,52	22,26	-1,10	-2,26	0,07	0,58	0,84	1,19	-1,45	-1,38	-2,05	6,57	1,83	0,89
CDI	2,52	3,00	6,63	13,32	0,44	0,43	0,36	0,31	0,27	0,21	0,20	0,13	0,15	0,16	0,15	0,16
Percent CDI	-218,00	93,04	218,87	167,11	-249,34	-527,61	19,08	187,89	309,08	570,71	-720,60	-1.024,37	-1.374,09	3.993,77	1.222,65	566,25
IBOV	-6,75	16,24	6,66	41,15	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16	1,94	6,00	-4,37	-3,32	9,30	15,90	-0,69
OURO	-3,80	-11,49	46,15	100,00	1,84	-1,81	8,19	-11,08	3,44	-0,81	0,10	-4,84	2,33	4,46	-12,32	2,37
POUPANCA1	1,67	2,02	4,74	9,45	0,30	0,24	0,24	0,20	0,16	0,16	0,12	0,12	0,12	0,12	0,12	0,12

Indicadores de Performance.

Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Ago 2021	Jul 2021	Jun 2021	Mai 2021	Abr 2021	Mar 2021	Fev 2021	Jan 2021	Dez 2020	Nov 2020	Out 2020
VaR (%)	3,37	3,33	3,43	2,80	2,98	4,71	2,22	3,00	3,45	3,01	3,81	3,42	3,44	3,13	2,96	2,71
Volatilidade (%)	7,10	7,01	7,22	5,90	6,28	9,93	4,67	6,33	7,26	6,33	8,03	7,19	7,25	6,60	6,24	5,71
Índice de Sharpe	-1,50	0,10	0,53	0,46	-3,44	-3,07	-0,68	0,55	0,97	1,96	-2,22	-2,93	-3,83	10,80	3,39	1,56



Quadro Estatístico	
Meses com retorno positivo:	105
Maior retorno mensal:	6,57% (Dez/2020)
Meses com retorno negativo:	14
Menor retorno mensal:	-3,20% (Set/2020)
Retorno acumulado:	133,20%
Retorno acumulado benchmark:	121,70%
Meses acima do benchmark:	53
Meses abaixo do benchmark:	66



(1) Este sistema está sob a coordenação de um Professor de Finanças da Faculdade de Economia e Administração da USP.
 (2) Não fazemos recomendação, oferta, solicitação, intermediação, compra, resgate ou venda de instrumentos financeiros.
 (3) As informações, dados e aplicativos disponibilizados pelo Comdinheiro não caracterizam uma recomendação de compra ou venda de título ou valor mobiliário, mas são ferramentas para o estudo e acompanhamento dos títulos e valores mobiliários com base em dados e informações publicadas e divulgadas pelos órgãos competentes.
 (4) Os cálculos contidos neste site foram realizados observando os princípios estabelecidos em artigos científicos, livros de autores reconhecidos pela academia, pela experiência do coordenador do site e pela inestimável contribuição advinda dos mais de 38.000 usuários registrados.
 (5) É de responsabilidade total e irrestrita do investidor decisões sobre seus investimentos, não podendo este site, seus diretores, gerentes ou funcionários serem responsabilizados por prejuízos oriundos de decisões tomadas com base em informações obtidas neste site.
 (6) Este site não assume nenhuma responsabilidade por defasagem, erro ou outra deficiência em informações prestadas, bem como por quaisquer perdas ou danos decorrentes de seu uso.
 (7) As informações de preços de ativos negociados nos mercados Estadunidenses são provenientes de Barchart. Esta informação é para propósito informativo apenas, não sendo permitido comercializá-las.