



VERDE AM GLOBAL ALPHA FIC FIM CP – IE

Relatório de Gestão

Dezembro de 2019

Desempenho	Dezembro 2019	Acumulado 2019
Global Alpha	-4,24%	8,29%
Libor 6M em BRL	-4,67%	6,34%

Para mais informações relevantes à análise da rentabilidade deste Fundo – tais como taxa de administração, taxa de performance, rentabilidade “mês a mês” ou PL médio, consulte o Resumo Gerencial ao final deste material.

O fundo Verde AM Global Alpha FIC FIM CP – IE teve uma rentabilidade negativa de 4,24% em dezembro e acumula uma rentabilidade de 8,29% no ano. A estratégia de global teve um efeito positivo de 0,87% e o câmbio impactou negativamente o resultado em 4,94% no período. Custos no mês acumularam um impacto negativo de 0,17%.

VERDE AM GLOBAL ALPHA FIC FIM CP – IE

Resumo Gerencial

31/dez/2019



Multiestratégia global que atua nos mercados de ações, renda fixa e moedas internacionais. Também pode utilizar estratégias de *hedges* globais e operações táticas. O produto é local, denominado em Reais e aplica a expertise em gestão de ativos internacionais desenvolvida *in house* desde 2002.

Público-alvo

O FUNDO tem como público alvo exclusivamente investidores profissionais que buscam a valorização de suas cotas através da aplicação no fundo de investimento VERDE AM GLOBAL ALPHA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO – INVESTIMENTO NO EXTERIOR, inscrito no CNPJ sob o n.º 18.679.873/0001–38.

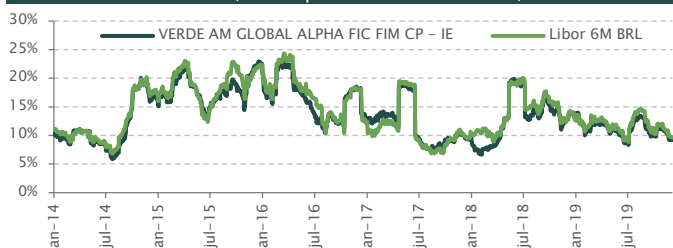
A descrição acima não pode ser considerada como objetivo do Fundo. Todas as informações obrigatórias estão disponíveis no formulário de informações complementares, na lâmina de informações essenciais (se houver) e/ou no regulamento, disponíveis em www.verdeasset.com.br

Características	
Data de início	29/nov/2013
Aplicação mínima	R\$ 500.000,00
Saldo mínimo	R\$ 500.000,00
Movimentação mínima	R\$ 100.000,00
Cota	Fechamento
Cota de aplicação *	D+1
Cota de resgate *	** D+0
Liquidação de resgate *	** D+3
Carência para resgate	Não há
Tributação aplicada	Longo Prazo
Taxa de saída antecipada	Não há
Taxa de administração ***	Não há. Verificar a taxa do fundo investido no regulamento.
Taxa de performance	Não há. Verificar a taxa do fundo investido no regulamento.

* Serão considerados dias úteis, em conjunto, na Capital do Estado de São Paulo, da Cidade de Nova York, NY, EUA e em Bermudas.
 ** O cotista que desejar efetuar resgate de suas cotas deverá efetuar pedido de resgate na sede ou dependências da Administradora, com antecedência mínima de 15 (quinze) dias do encerramento de cada mês calendário. O valor da cota utilizado para o resgate deve ser aquele apurado no fechamento do último dia útil de cada mês calendário. *** A taxa de administração máxima paga pelo Fundo, englobando a taxa de administração acima e as taxas de administração pagas pelo Fundo nos fundos que poderá eventualmente investir será de 2,00% a.a.

Aberto para novas aplicações	
Classificação ANBIMA:	Multimercados Investimento no Exterior
Admite Alavancagem:	Sim
Gestor:	Verde Asset Management S.A
Administrador:	Intrag Distribuidora De Títulos E Valores Mobiliários Ltda.

Volatilidade anualizada (Desvio padrão – média 40 dias)



Performance	Fundo	Libor 6M BRL
Retorno anualizado	9,64%	10,89%
Desvio padrão anualizado *	14,22%	14,85%
Índice de sharpe *	-0,03	0,06
Rentabilidade acumulada em 12 meses	8,29%	6,34%
Número de meses positivos	44	46
Número de meses negativos	29	27
Número de meses acima de 100% do Libor 6M em BRL	36	-
Número de meses abaixo de 100% do Libor 6M em BRL	37	-
Maior rentabilidade mensal	11,95%	12,30%
Menor rentabilidade mensal	-12,47%	-11,57%
Patrimônio líquido *	R\$	6.771.670,56
Patrimônio líquido médio em 12 meses	R\$	6.641.702,34

* Calculado desde sua constituição até 31/dez/2019

VERDE AM GLOBAL ALPHA FIC FI MULT – IE x Libor 6M BRL



Calculado até 31/dez/2019

Rentabilidades (%)

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum. Ano	Libor 6M BRL	Acum. Fdo.	Acum Libor 6M BRL*
2013												0,18	0,18	1,15	0,18	1,15
2014	0,05	-1,16	-2,53	-1,65	1,69	-0,81	1,63	0,23	7,67	0,43	5,46	2,81	14,17	12,96	14,38	14,25
2015	0,61	9,81	11,78	-5,61	6,33	-3,46	11,95	2,68	6,83	0,19	2,28	0,69	51,63	50,51	73,43	71,96
2016	-2,78	-2,34	-7,64	-3,50	6,57	-12,47	2,77	0,42	-0,15	-1,97	7,74	-1,65	-15,50	-17,43	46,54	41,98
2017	-4,06	-1,15	0,36	1,61	1,11	2,87	-5,09	0,40	1,36	3,35	0,84	1,36	2,64	2,95	50,41	46,17
2018	-1,38	-1,05	0,06	6,01	4,52	2,19	-1,93	7,70	-0,29	-9,08	3,08	-1,71	7,25	20,42	61,32	76,02
2019	-2,63	3,32	4,46	1,12	-0,86	-1,68	-2,02	8,27	0,66	-2,64	5,00	-4,24	8,29	6,34	74,69	87,19

* Calculado desde a constituição do fundo até 31/dez/2019

