

GAUSS MAPFRE JURO REAL PREVIDENCIÁRIO FIC FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

Perfil do Fundo
Público Alvo: Restrito aos recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre - PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre - VGBL instituídos pela Mapfre Previdência S.A.
Objetivo: O FUNDO tem como objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas.
Política: O FUNDO investirá no mínimo 95% de seus recursos no GAUSS MAPFRE JURO REAL FIFE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO.

Informações Gerais	
CNPJ	08.056.837/0001-64
Início do fundo	16/08/2006
Código Anbima	169900
Classificação Anbima	Previdência Multimercado Livre
Gestão	Gauss Capital Gestora De Recursos
Custodiante	S3 Caceis Brasil Distribuidora De Títulos E Valores Mobiliários S.A
Administrador	S3 Caceis Brasil Distribuidora De Títulos E Valores Mobiliários S.A
Aplicação	D+0
Resgate	D+0
Pagamento	D+1
Aplicação inicial	R\$ 1,00
Movimentação mínima	R\$ 1,00
Taxa de administração	Mín de 0,68 % Máx de 1,1 %
Taxa de performance	0 %
Patrimônio líquido	R\$ 123.650.233,48
Patrimônio médio em 12 meses	R\$ 133.128.287,13

Período da Análise: 16/08/2006 a 01/04/2024. Retornos em %.

Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Mar 2024	Fev 2024	Jan 2024	Dez 2023	Nov 2023	Out 2023	Set 2023	Ago 2023	Jul 2023	Jun 2023	Mai 2023
Fundo	-0,15	10,29	16,11	13,52	-0,02	0,13	0,48	-0,73	2,81	2,35	-0,51	-2,50	0,31	1,55	1,58	2,36
CDI	2,66	12,34	27,22	35,51	0,04	0,83	0,80	0,97	0,89	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12
Percent CDI	-5,58	83,38	59,18	38,08	-42,12	15,56	59,47	-75,84	314,50	256,60	-50,89	-256,68	27,58	144,54	147,79	209,88
IBOV	-5,36	25,11	4,71	8,06	-0,87	-0,71	0,99	-4,79	5,38	12,54	-2,94	0,71	-5,09	3,26	9,00	3,74
OURO						10,65	1,64	7,39	-0,98	-2,85	-0,99	-2,57	4,08	-0,17	-6,21	0,00
POUPANCA1	2,15	7,52	16,47	22,01	0,50	0,53	0,51	0,59	0,57	0,58	0,61	0,61	0,72	0,66	0,68	0,72

Indicadores de Performance.

Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Mar 2024	Fev 2024	Jan 2024	Dez 2023	Nov 2023	Out 2023	Set 2023	Ago 2023	Jul 2023	Jun 2023	Mai 2023
VaR (%)	1,14	2,01	2,31	2,52	1,17	1,19	0,88	1,32	1,51	1,97	3,49	2,71	1,58	2,37	1,93	1,56
Volatilidade (%)	2,40	4,22	4,87	5,30	2,47	2,51	1,86	2,77	3,18	4,16	7,35	5,71	3,32	4,99	4,06	3,28
Índice de Sharpe	-4,69	-0,46	-0,85	-1,10	-4,29	-3,51	-2,32	-7,01	7,47	4,29	-2,42	-7,70	-2,70	1,16	1,51	4,26

Retorno Acumulado (% Efetivo)



Patrimônio Líquido (R\$ milhões)



Quadro Estatístico

Meses com retorno positivo:	157
Maior retorno mensal:	8,28% (Mar/2016)
Meses com retorno negativo:	56
Menor retorno mensal:	-15,61% (Mar/2020)
Retorno acumulado:	347,64%
Retorno acumulado benchmark:	415,41%
Meses acima do benchmark:	94
Meses abaixo do benchmark:	119

Alocação por classe de ativo em 02/2024

