

Kadima Long Short Previdência FIM

JANEIRO 2024

SOBRE O FUNDO

O Kadima Long Short Previdência FIM é um fundo de previdência multimercado (FIFE), especialmente constituído para acolher recursos de fundos de previdência FIE, cujos únicos cotistas sejam sociedades seguradoras e entidades abertas de previdência complementar. A gestora utiliza majoritariamente uma abordagem quantitativa, na qual modelos matemático-estatísticos desenvolvidos pela equipe da Kadima Asset Management definem quais ativos comprar ou vender. O fundo tem como principal fator de risco posições long-short no mercado de ações, definidas por alguns destes algoritmos. Adicionalmente o fundo pode operar quaisquer outros ativos financeiros, obedecendo às restrições previstas na legislação e em seu regulamento.

Retornos Mensais

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2024	0,55												0,55
CDI+0,9%	1,05												1,05
2023	0,55	0,34	0,96	0,84	1,46	2,75	0,19	0,39	-0,50	-0,89	1,66	2,23	10,38
CDI+0,9%	1,20	0,98	1,26	0,98	1,20	1,15	1,15	1,22	1,05	1,07	0,99	0,97	14,05
2022	-2,25	0,88	3,13	2,20	0,99	-0,17	0,73	0,86	-1,52	1,52	-0,11	0,77	7,14
CDI+0,9%	0,81	0,82	1,00	0,90	1,11	1,09	1,11	1,25	1,15	1,09	1,09	1,20	13,38
2021	0,32	1,97	0,80	4,15	-0,25	0,00	0,01	1,27	0,18	0,38	0,65	2,42	12,48
CDI+0,9%	0,22	0,20	0,28	0,28	0,34	0,38	0,43	0,50	0,51	0,55	0,66	0,85	5,33
2020					1,61	1,32	1,32	0,38	-1,12	0,41	0,13	1,33	5,47
CDI+0,9%					0,15	0,29	0,28	0,24	0,23	0,23	0,22	0,24	1,89

CARACTERÍSTICAS

OBJETIVO

Superar o CDI no longo prazo

PÚBLICO ALVO

Fundo destinado a receber recursos direta ou indiretamente de provisões de VGBL e PGBL.

DATA DE INÍCIO: 15/05/2020

COTA DE APLICAÇÃO: D+0

COTA DE RESGATE: D+5 (úteis)

PAGAMENTO DE RESGATE

D+2 da cotização

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

1,00% a.a. (máx. 1,00% a.a.)

TAXA DE PERFORMANCE

20% do que exceder o CDI+0,9%

OUTROS DADOS

Favorecido: KADIMA LS PREV FIM

CNPJ: 34.979.876/0001-43

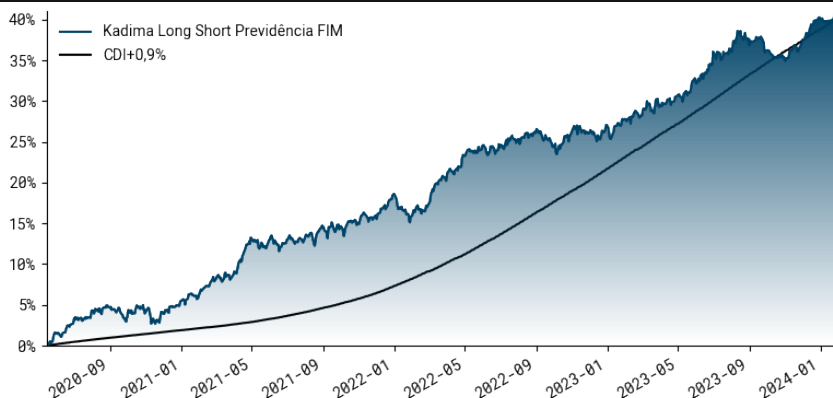
Horário de movimentação

Movimentações devem ser solicitadas até às 13:30hrs e, caso pertinente, os recursos devem estar disponíveis na conta até às 14:00hrs.

TRIBUTAÇÃO

IR: Varia conforme a tabela escolhida no plano de previdência complementar

	12 MESES	DESDE O INÍCIO
% FUNDO	10,38	41,06
CDI+0,9%	13,88	40,24



Este relatório é uma publicação cujo propósito é divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela Kadima Asset Management. As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo, não devem ser consideradas uma oferta para aquisição de cotas de fundos de investimento e não constituem prospecto, Formulário de Informações Complementares, Lâmina de Informações Essenciais ou Regulamento previstos na Instrução CVM 522, seguindo porém recomendações das diretrizes para publicidade e divulgação de material técnico de Fundos de Investimento da ANBIMA. Leia o Formulário de Informações Complementares, a Lâmina de Informações Essenciais e o Regulamento antes de investir. Fundos de Investimento não contam com garantia da Administradora, do Gestor, qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade passada não representa garantia rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e de eventual taxa de saída. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os termos "Master" e "Feeder" são comumente utilizados no meio financeiro para designar veículos de investimento que fazem parte de uma estrutura na qual vários fundos de cotas possam compartilhar de uma mesma estratégia. Os fundos de cotas são chamados "Feeders", pois aplicam recursos financeiros no fundo receptor, este chamado fundo "Master" no qual a estratégia é implementada.

PL E ESTATÍSTICAS

PATRIMÔNIO LÍQUIDO (R\$)

Atual	51.990.916
Médio 12 meses	56.889.557

Nº de meses > 0%	37 (82%)
Nº de meses < 0%	8 (18%)
Nº de meses > CDI	20 (44%)
Nº de meses < CDI	25 (56%)
Melhor mês	4,15%
Pior mês	-2,25%
Melhor dia	1,03%
Pior dia	-1,03%

	12 meses
Volatilidade	3,7%
Índice de Sharpe	-
Correl. X IHFA (ANBIMA)	38,16%
Correl. X Ibovespa	12,46%
Correl. X Dólar	-21,19%

MAXIMUM DRAWDOWN
-2,95% (31/12/21 a 27/01/22)

OUTROS

Gestor: Kadima Gestão de Investimentos Ltda.

Administrador: BTG Pactual Serviços

Financeiros S.A. DTMV

Custodiante: Banco BTG Pactual S.A.

Auditoria: Ernst & Young

Classificação ANBIMA: Previdência Multimercado Livre

Código ANBIMA: 536.474

Código Bloomberg: KADLSPR

Instagram: @kadimaasset

LinkedIn: www.linkedin.com/company/kadima-asset-management

