

Kadima Long Bias FIM

SETEMBRO 2024

SOBRE O FUNDO

O KADIMA LONG BIAS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO tem como objetivo obter retornos de longo prazo superiores ao seu benchmark, IPCA+X, através da aplicação majoritária de seus recursos no mercado de ações. Adicionalmente ao investimento de ações, o fundo utiliza outros mercados para tentar melhorar o retorno ajustado ao risco do fundo. A estratégia predominante do fundo é a quantitativa, na qual modelos matemático-estatísticos desenvolvidos pela equipe da Kadima Asset Management se valem de diversos indicadores de preços e fundamentos para a construção de seu portfólio.

Recomendamos aos interessados a leitura atenta do regulamento do fundo.

Retornos Mensais

| | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | ANO |
|--------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2024 | -1,15 | 1,22 | 0,65 | -3,65 | -2,08 | 2,14 | 1,57 | 5,38 | -0,54 | | | | 3,32 |
| IPCA+X | 1,02 | 1,01 | 1,02 | 0,77 | 0,93 | 0,90 | 0,84 | 0,73 | 0,71 | | | | 8,22 |
| 2023 | 0,96 | -3,77 | -1,14 | 0,92 | 3,23 | 6,92 | 1,10 | -2,83 | -1,42 | -4,62 | 8,11 | 5,58 | 12,80 |
| IPCA+X | 1,22 | 0,97 | 1,49 | 0,96 | 1,07 | 0,46 | 0,46 | 0,71 | 0,69 | 0,73 | 0,70 | 0,81 | 10,77 |
| 2022 | -2,83 | -0,20 | 6,57 | -2,31 | 2,06 | -8,24 | 2,95 | 3,17 | -3,79 | 4,38 | -5,30 | -0,27 | -4,75 |
| IPCA+X | 1,13 | 1,13 | 1,75 | 1,76 | 1,44 | 1,05 | 0,68 | 0,08 | 0,16 | 0,56 | 1,10 | 0,90 | 12,38 |
| 2021 | -0,16 | 4,50 | 4,33 | 10,54 | 0,35 | 0,24 | -1,07 | 1,86 | -5,04 | -2,85 | -1,48 | 6,20 | 17,73 |
| IPCA+X | 1,04 | 0,53 | 1,41 | 0,74 | 0,80 | 1,05 | 1,01 | 1,20 | 1,52 | 1,41 | 1,66 | 1,23 | 14,46 |
| 2020 | 4,30 | -2,04 | -24,84 | 8,65 | 5,27 | 5,95 | 4,86 | -0,34 | -3,72 | 0,79 | 4,81 | 4,16 | 3,03 |
| IPCA+X | 1,02 | 0,28 | 0,54 | 0,18 | -0,17 | 0,19 | 0,50 | 0,45 | 0,58 | 1,01 | 0,99 | 1,34 | 7,11 |
| 2019 | | | | | | | | 3,25 | 0,76 | 3,04 | 2,58 | 7,20 | 17,88 |
| IPCA+X | | | | | | | | 0,07 | 0,30 | 0,22 | 0,44 | 1,05 | 2,10 |

CARACTERÍSTICAS

OBJETIVO

Obter retornos de longo prazo superiores ao seu benchmark, IPCA+X.

PÚBLICO ALVO

Investidores em Geral

DATA DE INÍCIO: 26/08/2019

APLICAÇÃO INICIAL

R\$ 20.000,00

SALDO MÍNIMO

R\$ 20.000,00

MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA

R\$ 5.000,00

COTA DE APLICAÇÃO: D+0

COTA DE RESGATE: D+10 (corridos)

PAGAMENTO DE RESGATE

D+2 da cotização

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

1,75% a.a. (máx. 1,75% a.a.)

TAXA DE PERFORMANCE

20% do que exceder o IPCA+X

OUTROS DADOS

Favorecido: KADIMA LB FIM

CNPJ: 33.378.392/0001-86

Banco: 017

Agência: 001

Conta Corrente: 3570-0

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: 15% exclusivamente no resgate de cotas

IOF: Incidente sobre investimentos com menos de 30 dias.



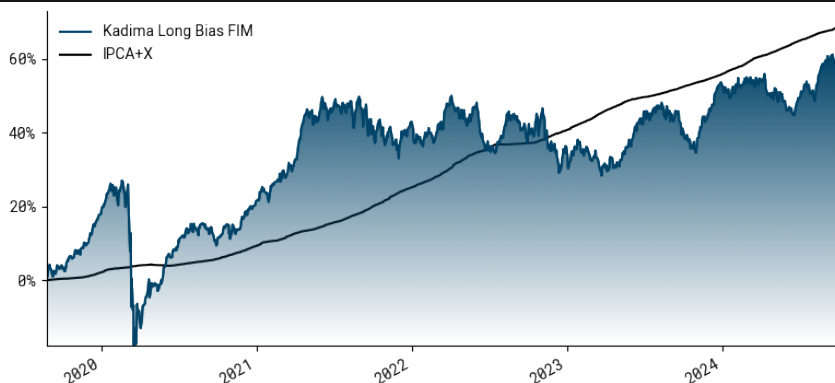
| | 12 MESES | DESDE O INÍCIO |
|---------|----------|----------------|
| % FUNDO | 12,48 | 58,72 |
| IPCA+X | 10,66 | 68,65 |

Liquidez da carteira de ações**

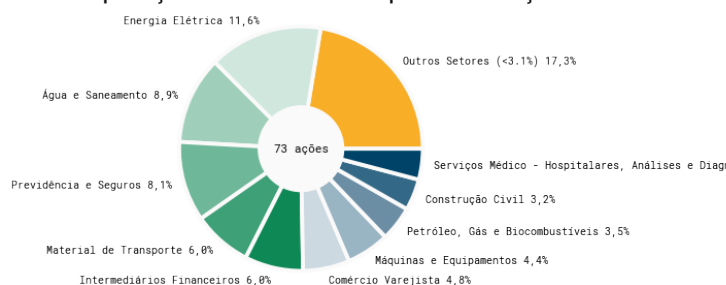
| | Exposição | Exposição net: |
|------------------------------|-----------|----------------|
| Acima de R\$ 20 MM: | 69,4% | 70,3% |
| Entre R\$ 10 MM e R\$ 20 MM: | 7,3% | |
| Entre R\$ 5 MM e R\$ 10 MM: | 0,3% | |
| Até R\$ 5 MM: | 0,0% | |
| Total de Ações: | 77,0% | |
| Índice Bovespa: | -6,7% | |

Valor de mercado da carteira de ações

| | Exposição |
|-----------------------------|-----------|
| Acima de R\$ 10 Bi: | 49,7% |
| Entre R\$ 5 Bi e R\$ 10 Bi: | 16,1% |
| Entre R\$ 1 Bi e R\$ 5 Bi: | 11,1% |
| Até R\$ 1 Bi: | 0,1% |



Composição da carteira comprada em ações



PATRIMÔNIO LÍQUIDO (R\$)

| | |
|----------------|------------|
| Atual | 17.378.728 |
| Médio 12 meses | 19.040.717 |

OUTRAS ESTATÍSTICAS

| | |
|------------------|------|
| Beta 12m | 0,57 |
| Volatilidade 12m | 8,9% |

OUTROS

Gestor: Kadima Gestão de Investimentos Ltda.

Administrador: BNY Mellon Serviços

Financeiros DTVM S/A

Custodiante: BNY Mellon Banco S.A.

Auditoria: KPMG Auditores Independentes

Classificação ANBIMA:

Código ANBIMA:

Código Bloomberg:

Instagram:

LinkedIn:

Multimercado Livre

505.307

KADIMLB

@kadimaasset

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

(**) Calculado com a média do volume diário nos últimos três meses de cada ação.

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.