

# Kadima Long Short Plus FIC FIA

JANEIRO 2024

## SOBRE O FUNDO

O KADIMA LONG SHORT PLUS FIA tem como objetivo prover retornos acima do CDI no longo prazo.

O FUNDO se classifica como um fundo de Ações, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado à vista de bolsas de valores ou entidades do mercado de balcão organizado.

O FUNDO poderá aplicar os recursos integrantes de sua carteira em quaisquer ativos financeiros permitidos pela legislação aplicável, podendo assumir posições compradas e vendidas, bem como utilizar-se de alavancagem, devendo-se observar, contudo, os ativos, limites de concentração e os riscos previstos no seu Regulamento.

## Retornos Mensais

|      | JAN   | FEV   | MAR   | ABR   | MAI   | JUN  | JUL   | AGO  | SET   | OUT   | NOV   | DEZ   | ANO   |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2024 | 1,94  |       |       |       |       |      |       |      |       |       |       |       | 1,94  |
| CDI  | 0,97  |       |       |       |       |      |       |      |       |       |       |       | 0,97  |
| 2023 | 0,98  | 0,74  | -0,12 | 0,39  | 0,59  | 2,75 | -0,49 | 0,48 | -0,21 | -0,74 | 0,09  | 1,58  | 6,15  |
| CDI  | 1,12  | 0,92  | 1,17  | 0,92  | 1,12  | 1,07 | 1,07  | 1,14 | 0,97  | 1,00  | 0,92  | 0,90  | 13,05 |
| 2022 | -2,77 | 0,63  | 2,55  | 3,07  | 0,47  | 0,03 | 1,16  | 0,12 | -1,94 | 1,18  | -0,15 | 1,49  | 5,83  |
| CDI  | 0,73  | 0,75  | 0,92  | 0,83  | 1,03  | 1,01 | 1,03  | 1,17 | 1,07  | 1,02  | 1,02  | 1,12  | 12,37 |
| 2021 | 1,42  | 2,67  | 0,59  | 3,89  | -0,19 | 0,15 | 0,07  | 1,37 | 0,05  | 0,14  | -0,53 | 2,09  | 12,26 |
| CDI  | 0,15  | 0,13  | 0,20  | 0,21  | 0,27  | 0,30 | 0,36  | 0,42 | 0,44  | 0,48  | 0,59  | 0,76  | 4,40  |
| 2020 | 2,85  | 0,17  | -7,23 | 2,70  | 2,81  | 1,48 | 2,18  | 0,04 | -1,82 | -0,17 | -0,02 | -0,67 | 1,89  |
| CDI  | 0,38  | 0,29  | 0,34  | 0,28  | 0,24  | 0,22 | 0,19  | 0,16 | 0,16  | 0,16  | 0,15  | 0,16  | 2,77  |
| 2019 | 0,56  | -1,92 | 3,25  | -0,06 | 0,59  | 2,19 | 0,29  | 0,45 | 0,06  | 1,62  | 1,53  | 3,22  | 12,29 |
| CDI  | 0,54  | 0,49  | 0,47  | 0,52  | 0,54  | 0,47 | 0,57  | 0,50 | 0,47  | 0,48  | 0,38  | 0,38  | 5,97  |
| 2018 |       |       |       |       |       |      |       |      |       |       | 0,79  | 0,07  | 0,86  |
| CDI  |       |       |       |       |       |      |       |      |       |       | 0,42  | 0,49  | 0,91  |

## CARACTERÍSTICAS

### OBJETIVO

Prover retornos acima do CDI no longo prazo.

### PÚBLICO ALVO

Investidores Qualificados

DATA DE INÍCIO: 06/11/2018

### APLICAÇÃO INICIAL

R\$ 100.000,00

### SALDO MÍNIMO

R\$ 100.000,00

### MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA

R\$ 500,00

COTA DE APLICAÇÃO: D+0

COTA DE RESGATE: D+10 (corridos)

### PAGAMENTO DE RESGATE

D+2 da cotização

### TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

2,00% a.a. (máx. 2% a.a.)

### TAXA DE PERFORMANCE

20% do que exceder o CDI

## OUTROS DADOS

Favorecido: KADIMA LONG SHORT PLUS FIC FIA

CNPJ: 31.455.960/0001-70

Banco: 017

Agência: 001

Conta Corrente: 2966-1

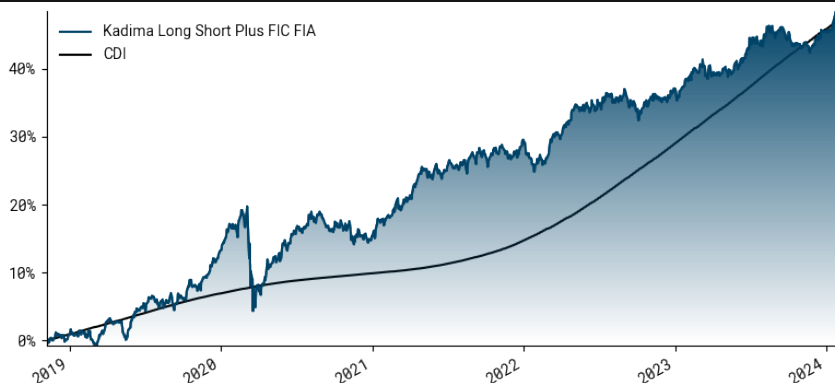
### Horário de movimentação

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% do rendimento auferido, pago no resgate de cotas

|         | 12 MESES | DESDE O INÍCIO |
|---------|----------|----------------|
| % FUNDO | 7,16     | 48,34          |
| CDI     | 12,87    | 47,15          |



## PL E ESTATÍSTICAS

### PATRIMÔNIO LÍQUIDO (R\$)

|                       |             |
|-----------------------|-------------|
| Atual                 | 188.139.771 |
| Médio 12 meses        | 210.718.954 |
| Atual Master          | 187.947.745 |
| Médio 12 meses Master | 210.417.362 |

|                   |          |                         |         |
|-------------------|----------|-------------------------|---------|
| Nº de meses > 0%  | 47 (75%) | Volatilidade            | 4,3%    |
| Nº de meses < 0%  | 16 (25%) | Índice de Sharpe        | -       |
| Nº de meses > CDI | 27 (43%) | Correl. X IHFA (ANBIMA) | 7,69%   |
| Nº de meses < CDI | 36 (57%) | Correl. X Ibovespa      | -21,92% |
| Melhor mês        | 3,89%    | Correl. X Dólar         | 1,19%   |
| Pior mês          | -7,23%   |                         |         |
| Melhor dia        | 3,23%    |                         |         |
| Pior dia          | -4,30%   |                         |         |

### MAXIMUM DRAWDOWN

-12,84% (04/03/20 a 18/03/20)

## 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:

Ações Livre

482.986

KADIMLN

@kadimaasset

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

(\*) Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. No caso do Imposto de Renda incidente sobre a valorização das cotas do fundo, fica expressamente ressalvado que a ocorrência de alteração nas alíquotas a que o aplicador está sujeito, ainda que provoque um ônus para o cotista, não poderá ser entendida ou interpretada como ato de responsabilidade da ADMINISTRADORA e/ou do GESTOR, tendo em conta que a gestão da carteira e, com efeito, suas repercussões fiscais, dão-se em regime de melhores esforços, pelo que a ADMINISTRADORA e o GESTOR não garantem aos cotistas no FUNDO qualquer resultado, mesmo que de natureza fiscal.

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.