

Kadima LT FIF Multimercado - RL

NOVEMBRO 2024

SOBRE O FUNDO

O Kadima LT FIF Multimercado - RL tem como objetivo prover retornos acima do CDI no longo prazo, utilizando-se majoritariamente de modelos matemático-estatísticos com objetivo de capturar tendências de longo prazo. O produto é descorrelacionado dos demais fundos multimercados da gestora. Entendemos que o Kadima LT é indicado a investidores que desejam exposição às grandes tendências de mercado, sem os vieses comportamentais humanos, e com todas as vantagens da gestão quantitativa.

A Classe 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	0,60	1,06	0,86	-2,02	1,03	3,25	0,46	0,57	0,54	2,04	6,67		15,86
CDI	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91	0,87	0,83	0,93	0,79		9,85
2023	0,27	0,85	2,72	0,68	1,37	4,52	0,44	-0,81	-4,17	-0,03	3,20	3,20	12,63
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	-2,32	1,61	4,99	-2,44	2,01	0,07	0,68	-0,99	-1,26	-1,81	-1,28	2,42	1,41
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	-1,68	1,93	0,44	0,66	-1,09	0,95	-1,15	3,60	1,07	6,66	0,02	0,78	12,59
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	0,85	3,45	2,82	2,46	0,40	0,81	-1,10	-1,80	-2,55	1,56	-3,67	1,95	4,99
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	-0,49	-1,20	-2,05	-0,27	2,45	4,44	2,24	0,87	1,19	0,43	-0,55	-1,18	5,86
CDI	0,52	0,49	0,47	0,52	0,54	0,47	0,57	0,50	0,47	0,48	0,38	0,38	5,94

CARACTERÍSTICAS

OBJETIVO

Prover retornos acima do CDI no longo prazo.

PÚBLICO ALVO

Investidores em Geral

DATA DE INÍCIO: 02/01/2019

APLICAÇÃO INICIAL

R\$ 5.000,00

SALDO MÍNIMO

R\$ 5.000,00

MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA

R\$ 1.000,00

COTA DE APLICAÇÃO: D+0

COTA DE RESGATE: D+10 (corridos)

PAGAMENTO DE RESGATE

D+1 dia 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 LT FIM

CNPJ: 31.923.761/0001-49

Banco: 017

Agência: 001

Conta Corrente: 3138-0

Horário de movimentação

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

TRIBUTAÇÃO

IR: Tabela de tarifas de fundos de longo prazo.

IOF: Incidente sobre investimentos com menos de 30 dias.

	12 MESES	DESDE O INÍCIO
% FUNDO	19,57	65,60
CDI	10,84	58,62



PL E ESTATÍSTICAS

PATRIMÔNIO LÍQUIDO (R\$)

Atual	18.413.511
Médio 12 meses	18.246.182

	12 meses
Nº de meses > 0%	48 (68%)
Nº de meses < 0%	23 (32%)
Nº de meses > CDI	36 (51%)
Nº de meses < CDI	35 (49%)
Melhor mês	6,67%
Pior mês	-4,17%
Melhor dia	2,37%
Pior dia	-1,83%
Volatilidade	6,4%
Índice de Sharpe	1,18
Correl. X IHFA (ANBIMA)	18,91%
Correl. X Ibovespa	-12,80%
Correl. X Dólar	20,50%

MAXIMUM DRAWDOWN

-8,75% (10/06/20 a 14/01/21)

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

484.032

BRMKADI

@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.