KADIMA FIC FI MULTIMERCADO

KADIMA ASSET MANAGEMENT

(ANTIGO KADIMA FIM) FEVEREIRO/2018

OBJETIVO
Prover retornos acima do CDI no longo prazo.

PÚBLICO ALVO
Investidores em geral que buscam retornos de longo prazo acima do CDI.

POLÍTICA DE INVESTIMENTO
A estratégia predominante utilizada pelo Fundo é a quantitativa, na qual modelos matemático-estatisticos desenvolvidos pela equipe da Kadima Asset Management pretendem capturar boas oportunidades de operação sistematicamente observadas no mercado, utilizando-se de diversos indicadores de preços e fundamentos.

Para tal, o Fundo aplica no mínimo 95% do seu patrimônio líquido em cotas do Kadima Master Fundo de Investimento Multimercado, cuja política de investimento envolve a atuação em diversos mercados: renda fixa, renda variável, commodities e seus derivativos, podendo assumir posições compradas e vendidas, bem como utilizar-se de alavancagem, conforme definido em seu regulamento, além de poder manter até 20% de seus recursos em ativos financeiros negociados no exterior.

CARACTERÍSTICAS

Publico Alvo: Investidor em geral
Aplicação Inicial: R$50,000.00
Movimentação Mínima: R$5,000.00
Saldo Mínimo: R$25,000.00
Cota de Aplicação: D+0
Cota de Resgate: D+0
Pagamento de Resgate: D+1
Taxa de Administração: 2% a.a. (máximo de 2,5% a.a.)
Taxa de Performance: 20% sobre o que exceder o CDI

TRIBUTAÇÃO

IR: Tabela de tarifas de fundos de Longo Prazo (*)
IOF: Incidente sobre investimentos com menos de 30 dias

DADOS BANCÁRIOS

Favorecido: Kadima FIC
CNPJ: 08.773.805/0001-80
Banco: BNY Mellon (017)
Agência: 001
Conta Corrente: [illegible]2
Horario para movimentação: Movimentações devem ser solicitadas até as 13:30 hrs e, caso pertinente, os recursos devem estar disponíveis na conta até as 14:00hrs

FUNDO FECHADO PARA APLICAÇÕES

OUTROS
Gestor: Kadima Gestão de Investimentos Ltda.
Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S/A
SAC Mellon: (21) 3219-2600
Ouvidoria Mellon: www.bnymellon.com.br/sf ou no telefone 0800 7253219
Custodiante: BNY Mellon Banco S.A.
Auditoria: KPMG Auditores Independentes
Classificação ANBIMA: Multimercados Livre
Código ANBIMA: 184.519
Código Bloomberg: KADFIML
Faixa de Risco Kadima: Agressivo

ANBIMA — A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

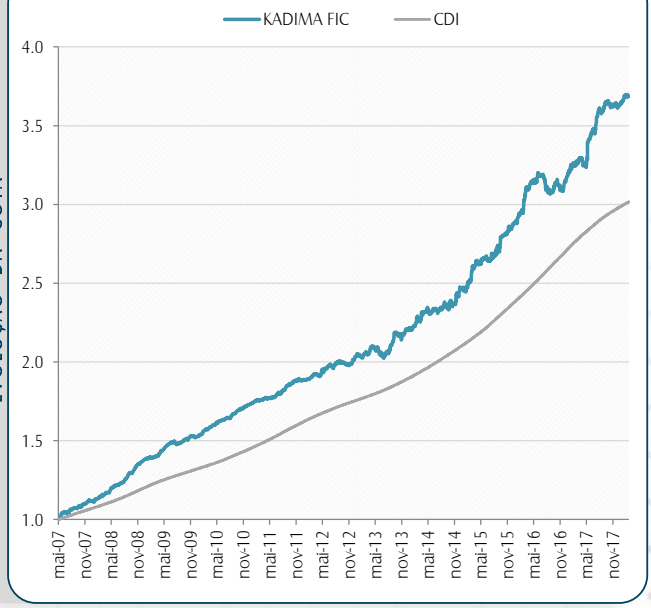
RENTABILIDADE

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2018	Fundo %	1.48	-0.04											1.44
	%CDI	253	-											137
2017	Fundo %	1.96	-0.04	1.12	-0.79	5.04	1.45	3.46	0.21	1.21	-0.11	0.11	-0.10	14.20
	%CDI	180	-	107	-	545	178	432	26	188	-	20	-	143
2016	Fundo %	1.91	0.23	5.03	1.89	-0.17	1.24	-1.78	-1.48	0.55	0.71	-1.13	3.18	10.43
	%CDI	181	23	433	179	-	107	-	-	50	67	-	283	74
2015	Fundo %	-0.30	2.34	3.13	0.91	1.09	-0.58	0.87	0.82	3.92	0.56	1.58	1.13	16.53
	%CDI	-	286	303	96	111	-	74	74	354	51	150	98	125
2014	Fundo %	0.30	2.67	1.39	0.49	-0.34	0.75	0.05	1.24	-1.37	1.58	2.54	1.75	11.55
	%CDI	35	342	183	61	-	91	5	145	-	167	303	183	107
2013	Fundo %	-0.10	0.89	0.45	1.73	-1.13	-0.91	-0.02	2.79	3.75	-0.62	0.38	1.44	8.88
	%CDI	-	186	84	288	-	-	-	402	537	-	54	185	110
2012	Fundo %	0.10	0.95	0.85	-0.32	2.20	1.21	-0.40	1.37	-0.34	-0.59	0.65	2.02	7.90
	%CDI	11	128	104	-	300	190	-	198	-	-	119	377	94
2011	Fundo %	0.89	0.13	0.71	0.18	0.29	1.22	0.41	1.96	1.05	1.16	0.49	-0.04	8.77
	%CDI	103	15	77	22	30	129	42	183	112	131	57	-	76
2010	Fundo %	0.80	2.09	0.92	0.85	1.53	0.37	0.53	1.64	1.32	0.96	0.70	1.01	13.47
	%CDI	121	353	122	129	203	47	61	185	156	119	87	109	138
2009	Fundo %	0.55	0.31	0.47	2.74	2.03	1.51	-0.69	0.36	1.01	1.13	0.86	-0.13	10.60
	%CDI	53	36	48	327	264	200	-	52	147	163	131	-	107
2008	Fundo %	1.01	1.57	1.20	1.82	2.47	0.62	1.36	2.76	1.88	3.58	1.56	1.54	23.54
	%CDI	110	197	144	203	283	65	128	272	172	305	156	139	190
2007	Fundo %					3.52	0.99	1.69	0.84	0.83	1.42	1.82	0.26	11.92
	%CDI					542	110	175	85	103	154	216	31	167

OBS.: O FUNDO teve início em 11-mai-07. Até o dia 6-dez-13 a taxa de performance era de 25% sobre o que excedesse o CDI.

	12 Meses	Desde o Início
Fundo %	13.67	268.71
%CDI	152	133

EVOLUÇÃO DA COTA



PL E ESTATÍSTICAS

PL R$	Atual	30,208,980
	Médio 12 meses	18,756,409
	Atual Master	155,806,381
	Médio 12m Master	119,350,629

		12 Meses
	Volatilidade	4.7%
	Índice de Sharpe	0.75
Correl.	IHFA - ANBIMA	-0.39
	Ibovespa	-0.18
	Dólar	0.19

Nº de meses > 0%	104 (81%)
Nº de meses < 0%	25 (19%)
Nº de meses > CDI	71 (55%)
Nº de meses < CDI	58 (45%)
Melhor Mês	5.04%
Pior Mês	-1.78%
Melhor Dia (18/05/17)	3.02%
Pior Dia (09/11/16)	-0.93%

Maximum Draw Down
-4.20% - (08/06/16 a 01/09/16)

www.kadimaasset.com.br - Av. Ataulfo de Paiva, nº226, 301 - Leblon - Tel.: 21 2540.0596 / 4107.5316 - email: contato@kadimaasset.com.br

O Kadima FIM foi transformado em Kadima FIC FIM em 29/07/2008. As rentabilidades e estatísticas divulgadas do Kadima FIC FIM incluem o período desde sua criação como Kadima FIM em 11/05/07, uma vez que não houve mudança na política de investimento, senão pelo fato de que esta passou a ser executada através do KADIMA MASTER FIM.

(*) 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 constitui 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.