

## Perfin Equity Hedge 15 FIC FIM

Aberto para captação

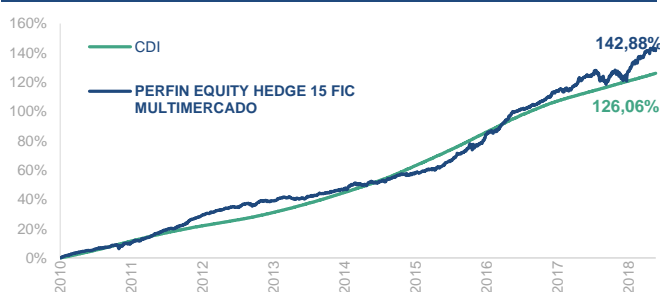
A estratégia **Perfin Equity Hedge** é uma oportunidade de investimento no mercado de ações com baixa volatilidade e preservação de capital. O portfólio possui uma alocação matricial da estratégia **Perfin Foresight (Long Only)**. As empresas da parcela Long (comprada) são escolhidas a partir da minuciosa análise, avaliando qualidade e valor intrínseco. Em adição, o portfólio se utiliza de Pair Trades (empresas compradas casadas com empresas vendidas) quando é identificada distorção de preço relativo. Na parcela Short (vendida), há posições em empresas ou no índice (Ibovespa). Os fundos não possuem alavancagem, sendo sua exposição bruta máxima de 100%.

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2019	Fundo	1,92%	-0,07%											1,85%
	CDI	0,54%	0,49%											1,04%
2018	Fundo	2,60%	0,31%	0,59%	1,14%	-2,10%	-0,28%	2,06%	-1,00%	0,30%	3,58%	1,55%	0,82%	9,86%
	CDI	0,58%	0,46%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%
2017	Fundo	2,19%	1,96%	0,89%	0,41%	1,03%	6,31%	0,92%	1,36%	1,53%	0,88%	-0,36%	1,24%	13,47%
	CDI	1,08%	0,86%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	0,80%	0,80%	0,64%	0,64%	0,57%	0,54%	9,93%
				2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	12M	24M	ACUM.	
	Fundo			3,51%	10,16%	16,12%	7,14%	6,15%	6,73%	19,04%	8,71%	21,85%	142,88%	
	CDI			2,27%	11,60%	8,40%	8,06%	10,81%	13,24%	14,00%	6,41%	15,93%	126,06%	

A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos

### PERFORMANCE

Retorno acumulado desde 11/10/2010



### RISCO X RETORNO

Equity Hedge 15 CDI

Retorno anualizado **11,2%** (desde o início) vs **10,3%** (desde o início)

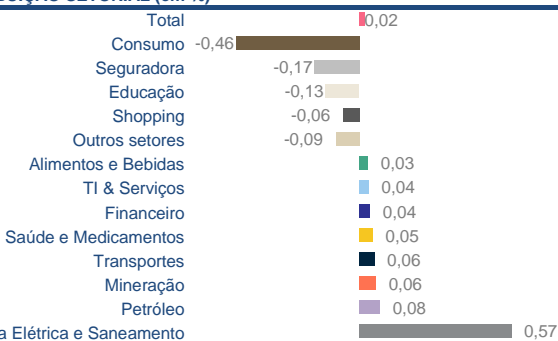
Volatilidade anualizada **4,3%** (24 M)

### PATRIMÔNIO (R\$ MM)

Valores decimais arredondados

PL atual **31.887.338** | PL últimos 12 meses **33.767.422** | PL atual da estratégia **63.556.520**

### CONTRIBUIÇÃO SETORIAL (em %)

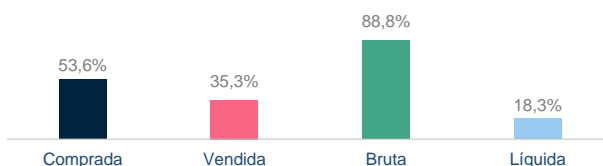


### CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO

Capitalização	% DO PL
> R\$ 5 bi	80
R\$ 1 bi - R\$ 5 bi	20
< R\$ 1 bi	0

### EXPOSIÇÃO GLOBAL DO PORTFÓLIO

31/01/2019



### CONTRIBUIÇÃO POR ESTRATÉGIA (em %)

ATRIBUIÇÃO\*

Carteira Alpha (Long)	-0,31
Carteira Alpha (Short)	0,05
Pair Trade (Ibov)	0,00
Pair Trade (Equities)	-0,46
Opções e Futuros (Hedge)	0,25
Renda Fixa / Caixa	0,42
Custos	-0,03
<b>Total</b>	<b>-0,07</b>

\*Pares intrasetoriais; Pares intersetoriais classificados como "outros"

### INFORMAÇÕES GERAIS

Categoria Anbima: Long and Short Direcional (259063)  
 Gestor: Perfin Administração de Recursos LTDA  
 Administrador: Bradesco  
 Custodiante: Bradesco  
 Auditor: Ernst & Young Auditores Independentes  
 Início do fundo: 11 de outubro de 2010  
 Imposto de renda: Para investimentos com prazo de até 6 meses, alíquota de 22,5%. Entre 6 e 12 meses, alíquota de 20%. Entre 12 e 24 meses, alíquota de 17,5% e, mais de 24 meses, alíquota de 15%.

Aplicação mínima: R\$ 5.000,00  
 Movimentação mínima: R\$ 5.000,00  
 Saldo mínimo: R\$ 5.000,00  
 Cota de aplicação: D+0 para solicitações efetuadas até as 14hs.  
 Cota de resgate: D+15 (úteis) para solicitações efetuadas até 14hs.  
 Liquidação resgate: D+1 (úteis após a cotação)  
 Taxa de administração: 1,5% a.a.  
 Taxa de performance: 20% sobre o que exceder CDI (marca d'água)

Para informações sobre investimento, favor entrar em contato

comercial@perfin.com.br | 55 11 2526 2400 | Rua Amauri, 286 - 2º andar - Itaim Bibi - 01448-000 - São Paulo - SP