

## Perfin Equity Hedge 15 FIC FIM

Aberto para captação

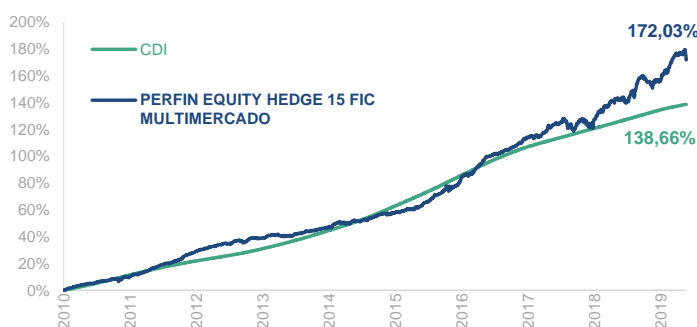
A estratégia **Perfin Equity Hedge** é uma oportunidade de investimento no mercado de ações com baixa volatilidade e preservação de capital. O portfólio possui uma alocação matricial da estratégia **Perfin Foresight (Long Only)**. As empresas da parcela Long (comprada) são escolhidas a partir da minuciosa 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
2020	Fundo	0,12%	-1,52%											-1,40%
	CDI	0,38%	0,29%											0,67%
2019	Fundo	1,92%	-0,07%	-0,59%	2,72%	2,47%	2,23%	-1,78%	0,02%	0,65%	2,39%	1,81%	3,01%	15,69%
	CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%	0,48%	0,38%	0,37%	5,96%
2018	Fundo	2,60%	0,31%	0,59%	1,14%	-2,10%	6,31%	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%
			2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	12M	24M	ACUM.	
	Fundo		3,51%	10,16%	16,12%	7,14%	6,15%	6,73%	19,04%	13,47%	12,00%	21,76%	172,03%	
	CDI		2,27%	11,60%	8,40%	8,06%	10,81%	13,24%	14,00%	9,93%	5,57%	12,34%	138,66%	

A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos

### PERFORMANCE

Retorno acumulado desde 11/10/2010



### RISCO X RETORNO

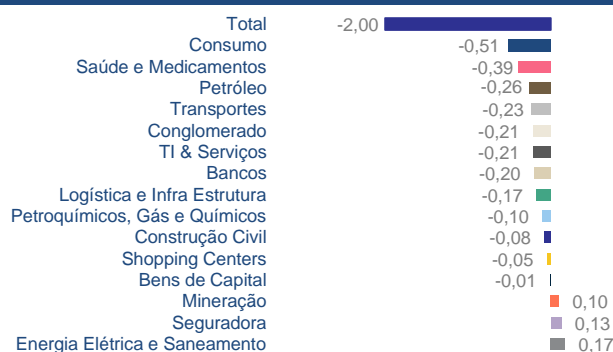
	Equity Hedge 15	CDI
Retorno anualizado	11,3% (desde o início)	9,7% (desde o início)
Volatilidade anualizada	5,4% (24 M)	

### PATRIMÔNIO (R\$ MM)

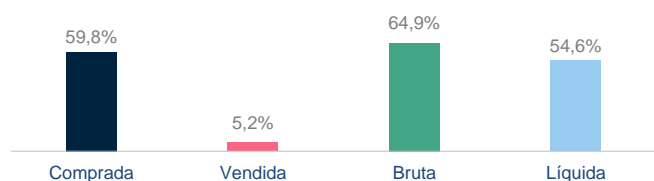
Valores decimais arredondados

PL atual	PL últimos 12 meses	PL atual da estratégia
244.628.679	86.557.416	413.325.987

### PRINCIPAIS CONTRIBUIÇÕES SETORIAIS (em %)



### EXPOSIÇÃO GLOBAL DO PORTFÓLIO



### CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO

% DO PL

Capitalização	% DO PL
> R\$ 5 bi	72
R\$ 1 bi - R\$ 5 bi	28
< R\$ 1 bi	0

### CONTRIBUIÇÃO POR ESTRATÉGIA (em %)

ATRIBUIÇÃO\*

Carteira Alpha (Long)	-2,26
Carteira Alpha (Short)	0,18
Pair Trade (Ibov)	0,00
Pair Trade (Equities)	0,00
Opções e Futuros (Hedge)	0,73
Renda Fixa / Caixa	0,20
Custos	-0,37
<b>Total</b>	<b>1,52</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 cotização)
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, 255 - 2º andar - Itaim Bibi - 01448-000 - São Paulo - SP