



Navi Long Short Icatu Prev FIM
Janeiro 2020

Descrição do Fundo

O Fundo tem por objetivo buscar retorno aos seus cotistas através de investimentos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica. O Fundo é destinado a receber, exclusivamente, recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre – PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre – VGBL instituídos pela ICATU SEGUROS S.A.

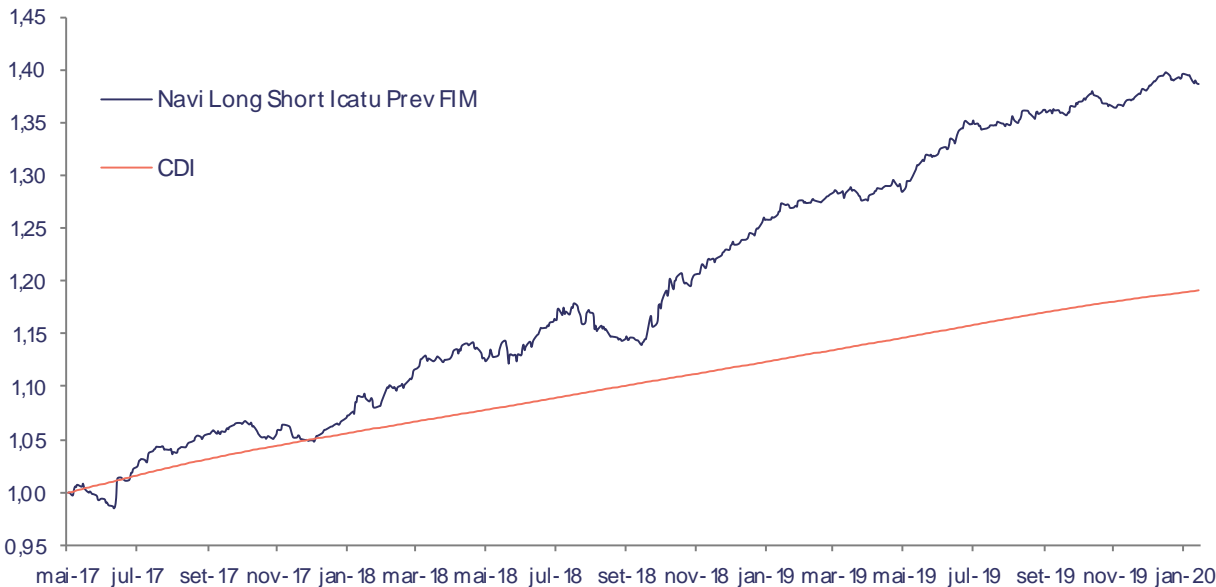
Rentabilidade Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	% CDI
2017					0,87%	0,44%	2,58%	0,74%	1,05%	-0,17%	-0,19%	0,52%	5,96%	112%
2018	2,96%	0,68%	2,60%	1,25%	-0,50%	0,84%	2,27%	-1,39%	-0,92%	4,97%	1,62%	1,55%	16,96%	264%
2019	2,76%	0,35%	0,48%	0,34%	1,66%	1,92%	0,78%	1,17%	0,06%	1,09%	-0,41%	1,71%	12,52%	210%
2020	-0,57%												-0,57%	-

Data de Início: 18/05/2017

Rentabilidade acumulada desde o início do Fundo, líquida de taxa de administração e performance, mas bruta de impostos.

Performance Comparativa



Informações Gerais

Classificação ANBIMA	Previdência Multimercados
Aplicação Mínima	Consultar a Seguradora
Ap. Mín. (Conta e Ordem)	Consultar a Seguradora
Movimentação	Consultar a Seguradora
Cota de Aplicação	D+0
Cota Resgate	D+1
Liquidação Resgate	2º dia útil após a cotização
Horário de Movimentação	Até 14h
IR	Previdência
Taxa de Administração	2% a.a.
Taxa de Performance	Não há
Ticker Bloomberg	KONDICA BZ
Público Alvo	Investidores em geral
CNPJ	27.328.750/0001-43
Dados Bancários	Banco: 237 / Ag: 2856 / CC: 17644-3
Contato	(21) 3590-2410
WebSite	www.navi.com.br
Gestora	Navi Capital Adm. e Gestora de Recursos Financeiros Ltda
Administrador	BEM DTVM Ltda.
Custodiante	Banco Bradesco S.A.
Auditoria	PricewaterhouseCoopers

Dados Técnicos

Patrimônio Líquido	91,895,766		
P.L. Médio (12 Meses)	88,503,815		
Pior Mês	-1,39%	ago-18	
Melhor Mês	4,97%	out-18	
	Início	24M	12M
Retorno Acumulado	38.66%	27.09%	8.88%
Retorno Mensal Médio	1.02%	1.00%	0.71%
Desvio Padrão Anualizado	4.20%	4.26%	2.73%
Sharpe Anualizado ³	1.48	1.56	1.14
Alpha contra CDI (a.a.)	6.21%	6.65%	3.10%
Meses Positivos	79%	79%	83%
Meses Negativos	21%	21%	17%

³ Sharpe calculado com base nos retornos diários anualizados do fundo. Taxa livre de Risco utilizada: CDI.