

FUTURA ARB FIM



Dezembro 2024

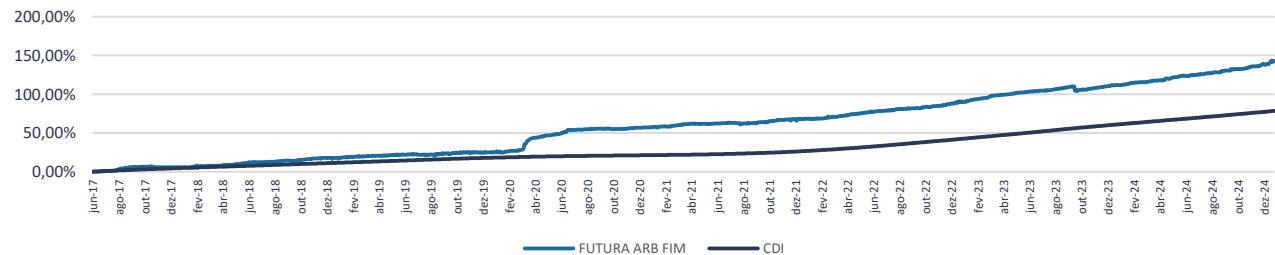
OBJETIVO

O FUTURA ARB FIM tem como objetivo superar o benchmark de 105% do CDI através de estratégias de arbitragem de conversíveis e futuros, com baixa volatilidade, sem correlação com o Ibovespa e Sharpe alvo acima de 1. O fundo conta com infraestrutura global, tecnologia própria e algoritmos customizados para execução automatizada das estratégias, permitindo estar presente no book em centenas de pares em diferentes mercados globais 100% do tempo, capturando distorções e gerando alpha em cenários de alta volatilidade. O fundo apresenta curva de risco similar à renda fixa, com rentabilidade constante acima do CDI e retornos excedentes em cenários de alta volatilidade ou eventos relevantes (Joesley Day, Covid, fatos relevantes em papéis específicos).

RENTABILIDADE MENSAL

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2017	FUTURA ARB FIM						1,20%	0,89%	3,56%	0,62%	-0,54%	-0,19%	0,14%	5,77%	5,77%
	CDI						0,62%	0,80%	0,80%	0,64%	0,64%	0,57%	0,54%	4,69%	4,69%
2018	FUTURA ARB FIM	0,49%	0,89%	0,50%	1,00%	2,24%	0,68%	0,27%	1,60%	0,50%	1,51%	1,10%	0,23%	11,58%	18,02%
	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%	11,41%
2019	FUTURA ARB FIM	1,12%	0,18%	0,52%	0,89%	0,82%	0,26%	-0,86%	0,97%	1,26%	0,84%	-0,58%	0,33%	5,89%	24,97%
	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%	18,05%
2020	FUTURA ARB FIM	0,97%	1,20%	12,16%	2,23%	1,41%	3,41%	0,75%	0,49%	-0,03%	-0,11%	0,89%	0,67%	26,16%	57,66%
	CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,76%	21,31%
2021	FUTURA ARB FIM	0,48%	0,70%	1,33%	0,06%	0,33%	0,39%	-1,04%	1,04%	0,63%	1,77%	0,50%	0,53%	6,90%	68,54%
	CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	4,42%	26,68%
2022	FUTURA ARB FIM	0,06%	1,01%	1,30%	1,29%	1,19%	0,87%	1,22%	0,45%	0,90%	0,82%	1,55%	1,61%	12,99%	90,43%
	CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,39%	42,37%
2023	FUTURA ARB FIM	1,49%	1,10%	1,81%	0,86%	1,17%	0,73%	0,57%	1,33%	-1,48%	1,00%	1,31%	0,91%	11,32%	111,98%
	CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,89%	13,04%	60,94%
2024	FUTURA ARB FIM	1,08%	0,67%	0,82%	1,20%	1,80%	0,18%	1,23%	1,32%	1,03%	0,82%	1,31%	2,20%	14,53%	142,80%
	CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,84%	0,93%	0,79%	0,93%	10,88%	78,44%

RENTABILIDADE ACUMULADA



INDICADORES

Rentabilidade (início)	142,80%	Volatilidade (últimos 12 meses)	2,48%
Meses Positivos	83	Patrimônio Líquido	R\$ 58.621.883,96
Meses Negativos	8	Patrimônio Líquido (média 12 meses)	R\$ 58.392.114,12

INFORMAÇÕES GERAIS

Data de Início	07/06/2017	CNPJ	27.011.904/0001-79
Público-alvo	Investidor Qualificado	Classificação ANBIMA	Multimercados Livre
Taxa de Administração	0,375%	Aplicação Mínima	R\$ 5.000,00
Taxa de Performance	50% sobre o que exceder 105% do CDI	Movimentação Mínima	R\$ 1.000,00
Tributação Alvo	Renda Variável	Saldo Mínimo	R\$ 5.000,00
Gestor	NOVA FUTURA GESTORA DE RECURSOS LTDA	Horário Limite para Movimentação	14:00
Administrador	NOVA FUTURA CTVM LTDA	Aplicação (Cotização):	D+1 (Dias úteis)
Custodiante	Banco B3 S.A.	Resgate (Cotização):	D+1 (Dias úteis)
Auditor Independente	NEXT AUDITORES INDEPENDENTES S/S LTDA.	Resgate (Pagamento):	D+4 (Dias úteis) após cotização

CANAIS DE ATENDIMENTO

NOVA FUTURA GESTORA DE RECURSOS LTDA
nfgestora.gestao@novafutura.com.br
(11) 4871-1049
Alameda Santos, 960 - 10º andar | Cerqueira Cesar | São Paulo - SP | 01.418-002

NOVA FUTURA INVESTIMENTOS
Telefones:
Clientes Pessoas Físicas
Capitais e Regiões Metropolitanas: 4020-6710
São Paulo: (11) 3291-8000
Demais Regiões: 0800 580 6710
Ouvidoria: 0800 724 3080
Clientes Institucionais: (11) 3195-6998
E-mail:
E-mail atendimento:
atendimento@novafutura.com.br
E-mail plataformas:
plataformas@novafutura.com.br



Gestão de Recursos

LEIA A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS (SE HOUVER), O REGULAMENTO, COMUNICADOS E EVENTUAIS FATOS RELEVANTES ANTES DE INVESTIR. ESSES DOCUMENTOS PODEM SER OBTIDOS NA SEÇÃO DE INFORMAÇÕES AOS COTISTAS DO SITE DO ADMINISTRADOR DOS FUNDOS (www.novafutura.com.br/ ...). A RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, DO GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS – FGC. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. PARA AVALIAÇÃO DA PERFORMANCE DE QUALQUER FUNDOS DE INVESTIMENTOS, É RECOMENDÁVEL UMA ANÁLISE DE PERÍODO DE, NO MÍNIMO, 12 (DOZE) MESES. AS COMPARAÇÕES A CERTOS ÍNDICES DE MERCADO FORAM INCLuíDAS PARA REFERÊNCIA APENAS E NÃO REPRESENTAM GARANTIA DE RETORNO PELA NOVA FUTURA GESTORA.

O valor do patrimônio líquido do fundo contido neste relatório é líquido das despesas dos Fundos (i.e. honorários, comissões e impostos). Nesse fundo, a data de conversão de cotas é diversa da data de pagamento do resgate. Não há garantia de que os fundos multimercado terão o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Os fundos estão autorizados a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Os fundos podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Os fundos utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo.

As informações contidas neste material referem-se às várias empresas componentes da Nova Futura Investimentos e/ou seus respectivos produtos. A Nova Futura não se responsabiliza por erros, omissões ou imprecisões no conteúdo das informações divulgadas. As informações divulgadas neste material têm caráter meramente informativo, não se constituindo em oferta de venda de cotas dos fundos ou de qualquer outro ativo mencionado. No caso de divergência entre as informações contidas neste relatório e aquelas contidas no extrato mensal emitido pelo Administrador do Fundo, as informações contidas no referido extrato mensal prevalecerão sobre as informações deste relatório.