

# TLS II

## Kinea TLS II FICFIM - Dezembro 2022 (CNPJ: 39.913.995/0001-17)

# Kinea

uma empresa **Itaú**

### Rentabilidade Histórica

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2021					0,13%	1,87%	(0,81%)	0,29%	2,49%	(0,76%)	0,31%	0,95%	4,50%
CDI					0,04%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	3,44%
%CDI					329,88%	611,97%		67,35%	569,16%		52,92%	123,78%	130,76%
2022	2,48%	0,98%	1,96%	1,14%	0,88%	0,12%	1,56%	1,93%	1,30%	1,54%	(1,28%)	0,89%	14,31%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%		1,12%	12,37%
%CDI	338,75%	131,28%	212,09%	136,39%	85,65%	11,93%	151,01%	165,09%	120,82%	150,67%		79,45%	115,69%

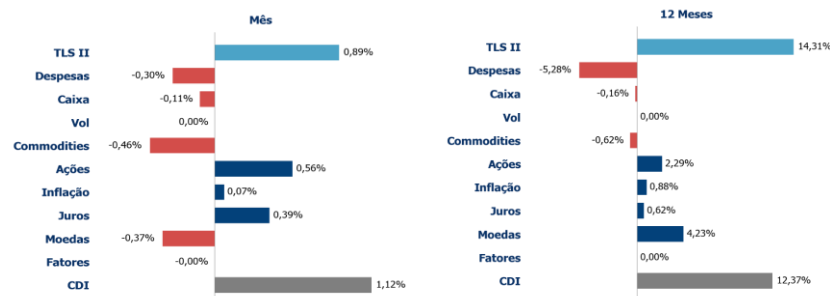
### Rentabilidade Acumulada | Patrimônio Líquido (R\$ milhões)



### Estatísticas

Rent. Absoluta	12 meses	14,31%	24 meses	-	36 meses	-	48 meses	-	Início	19,46%
CDI		12,37%								16,24%
% CDI		115,69%								119,82%
Vol. Anualizada		3,18%								3,45%
Maior retorno mensal (desde o início)							Rent. Abs.	2,49%	% CDI	569,16%
Pior retorno mensal (desde o início)								(1,28%)		Mês
Média retorno mensal (desde o início)								0,90%		set/21
										nov/22
Meses positivos		17								
Meses negativos		3								
Meses acima do CDI		12					Patr. Líq. Atual			13.113.093
Meses abaixo do CDI		8					Patr. Líq. Médio (12 m)			13.886.831

### Atribuição de Performance



### Objetivo do Fundo

O objetivo do FUNDO é aplicar seus recursos em ativos financeiros de diferentes naturezas e características, definindo as estratégias de investimento com base em cenários macroeconômicos de médio e longo prazo, atuando de forma direcional, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial, observado que a rentabilidade do FUNDO será impactada em virtude dos custos e despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração, se houver

### Público alvo

Investidores em geral, pessoas físicas e jurídicas, que buscam retornos acima do CDI no longo prazo e que tenham maior apetite para risco.

Categoria Anbima	590142	Taxa de Administração Max.	2% a.a.	Solicitação de Aplic.	D+0
Código Anbima	Kinea Investimentos Ltda.	Taxa de Performance	20% do que exceder o CDI	Cota de Resg.	D+29 (úteis da solicitação)
Gestor	Intrag			Pagamento de Resg.	D+30 (útil) da conversão da cota
Administrador	Itaú Unibanco SA	Aplicação Inicial	R\$ 1	Dados Bancários:	
Custodiante	PwC	Movimentação Mín.	R\$ 1	Conta SELIC	
Auditoria	26/mai/21	Saldo Mínimo	R\$ 1		
Início do Fundo					

\* Fatores: estratégia quantitativa de apropriação de prêmios nos mercados de ações e opções internacionais. Os prêmios (fatores) possuem longa evidência empírica e são fundamentados economicamente.



Kinea Investimentos Ltda.  
Rua Minas da Prata, 30- 4º andar 04552-080  
São Paulo - SP  
Telefones: (55 11) 3073-8700 / 3073-8797 (fax)  
kinea@kinea.com.br - www.kinea.com.br

Intrag DTVM Ltda  
Praça Alfredo Egidio de Souza Aranha, 100  
Torre Olavo Setúbal 04344-902 São Paulo SP  
intrag@itau-unibanco.com.br

Este material foi elaborado pela Kinea (Kinea Investimentos Ltda e Kinea Private Equity Investimentos S.A.), empresa do Grupo Itaú Unibanco. A Kinea não comercializa e nem distribui cotas de fundos de investimentos. Leia o regulamento e demais documentos legais do fundo antes de investir. Os fundos são supervisionados e fiscalizados pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM. Os fundos de condomínio aberto e não destinados a investidores qualificados possuem lâminas de informações essenciais. A descrição do tipo ANBIMA consta no formulário de informações complementares. Estes documentos podem ser consultados no site da CVM <http://www.cvm.gov.br/> ou no site dos respectivos Administradores dos fundos. Não há garantia de tratamento tributário de longo prazo para os fundos que informam buscar este tratamento no regulamento. Os fundos da Kinea não são registrados nos Estados Unidos da América sob o Investment Company Act de 1940 ou sob o Securities Act de 1933. Não podem ser oferecidos ou vendidos nos Estados Unidos da América ou em qualquer um de seus territórios, possessões ou áreas sujeitas a sua jurisdição, ou a pessoas que sejam consideradas como U.S. Persons para fins da regulamentação do mercado de capitais norte-americano. Os Fundos de Investimento da Kinea podem apresentar um alto grau de volatilidade e risco. Alguns fundos informam no regulamento que utilizam estratégias com derivativos como parte de sua política de investimento, que da forma que são adotadas, podem resultar em perdas de patrimônio financeiro para seus cotistas superiores ao capital aplicado, obrigando o cotista a aportar recursos adicionais para cobertura do fundo. É recomendada uma avaliação de performance de fundos de investimento em análise de no mínimo 12 meses. A rentabilidade passada não garante a rentabilidade futura e fundos de investimento não são garantidos pela Instituição Administradora, ou por qualquer mecanismo de seguro, ou ainda pelo Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Os Fundos de Investimento em Participações seguem a ICVM 578, portanto são condomínios fechados em que as cotas somente são resgatadas ao término do prazo de duração do fundo. Esta modalidade concentra a carteira em poucos ativos de baixa liquidez, o que pode resultar em perdas de patrimônio financeiro para seus cotistas que podem superar o capital aplicado, acarretando na obrigatoriedade do cotista aportar recursos adicionais para cobertura do fundo no caso de resultado negativo. Os Fundos de Investimento Imobiliário seguem a ICVM571, portanto são condomínios fechados em que as cotas não são resgatáveis onde os cotistas podem ter dificuldade em alienar suas cotas no mercado secundário. As opiniões, estimativas e projeções refletem o atual julgamento do responsável pelo seu conteúdo na data de sua divulgação e estão, portanto, sujeitas a alterações sem aviso prévio. As projeções utilizam dados históricos e suposições, de forma que devem ser realizadas as seguintes advertências: (1) Não estão livres de erros; (2) Não é possível garantir que os cenários obtidos venham efetivamente a ocorrer; (3) Não configuram, em nenhuma hipótese, promessa ou garantia de retorno esperado nem de exposição máxima de perda; e (4) Não devem ser utilizadas para embasar nenhum procedimento administrativo perante órgãos fiscalizadores ou reguladores. Este conteúdo é informativo e não constitui nem deve ser interpretado como oferta ou solicitação de compra ou venda de valores mobiliários, instrumento financeiro ou de participação em qualquer estratégia de negócios específica, qualquer que seja a jurisdição. Algumas das informações aqui contidas foram obtidas com base em dados de mercado e de fontes públicas consideradas confiáveis. O Grupo Itaú Unibanco e a Kinea não declaram ou garantem, de forma expressa ou implícita, a integridade, confiabilidade ou exatidão de tais informações e se eximem de qualquer responsabilidade por quaisquer prejuízos, diretos ou indiretos, que venham a decorrer da utilização desse material e de seu conteúdo. Esse material não pode ser reproduzido ou redistribuído para qualquer pessoa, no todo ou em parte, qualquer que seja o propósito, sem o prévio consentimento por escrito da Kinea. Quaisquer outras informações ou esclarecimentos sobre o Fundo poderão ser obtidos com o Administrador e o Gestor, através do e-mail: [relacionamento@kinea.com.br](mailto:relacionamento@kinea.com.br).