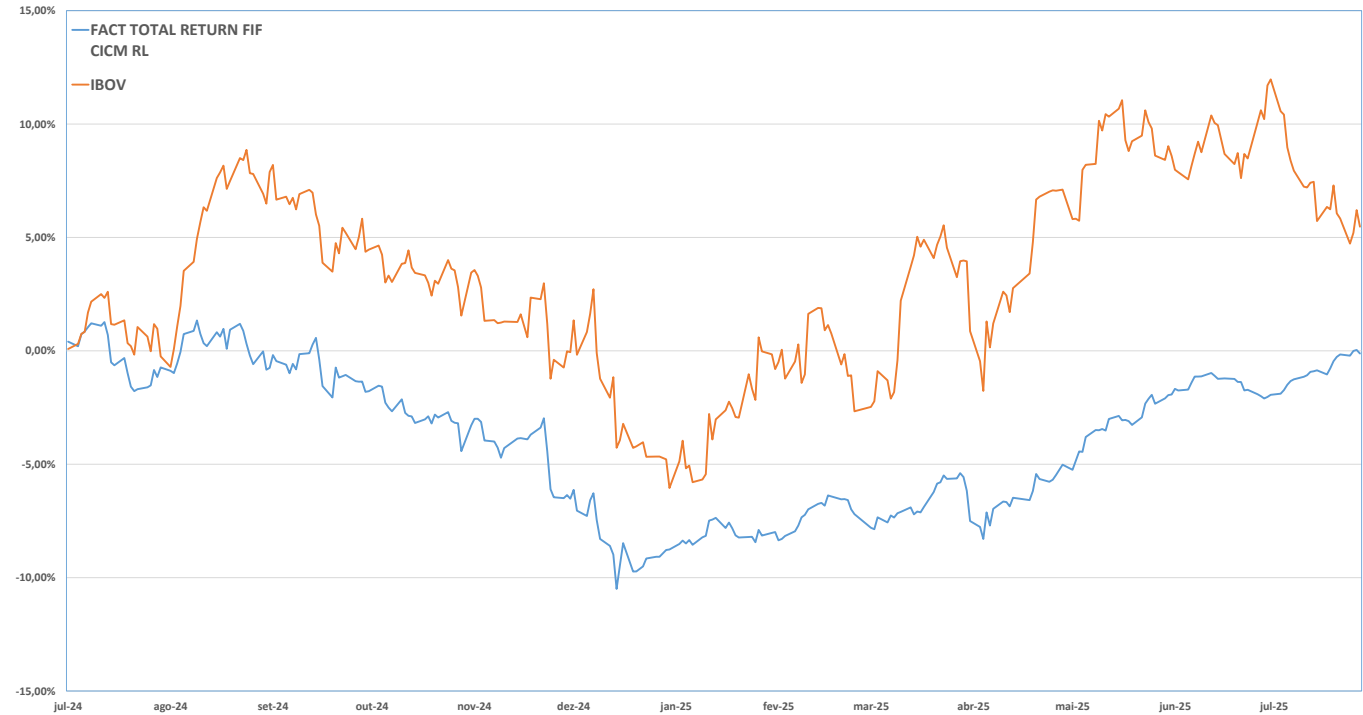


Objetivo: Obter retornos superiores ao IBOVESPA, consistentes e descorrelacionados no longo prazo, por meio de carteira diversificada de investimentos ajustada ao mandato de risco definido.

Rentabilidade Mensal

	2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INICIO
FUNDO								-0,85%	0,26%	-0,76%	-1,88%	-3,37%	-2,81%	-9,08%	-9,08%
IBOV								1,18%	6,54%	-3,08%	-1,60%	-3,12%	-4,28%	-4,66%	-4,66%
FUNDO		1,03%	1,03%	1,70%	0,16%	3,32%	0,43%	1,83%						9,86%	-0,12%
IBOV		4,86%	-2,64%	6,08%	3,69%	1,45%	1,33%	-4,17%						10,63%	5,47%

Retorno desde 05/07/2024



Informações do Fundo

Rentabilidade Acumulada	Inception (05/07/2024)
Retorno	-0,12%
IBOV	5,47%
Volatilidade Anualizada	7,2%
Sharpe	-
% Meses acima IBOV	38%
Melhor Mês Pior Mês	3,32% / -3,37%

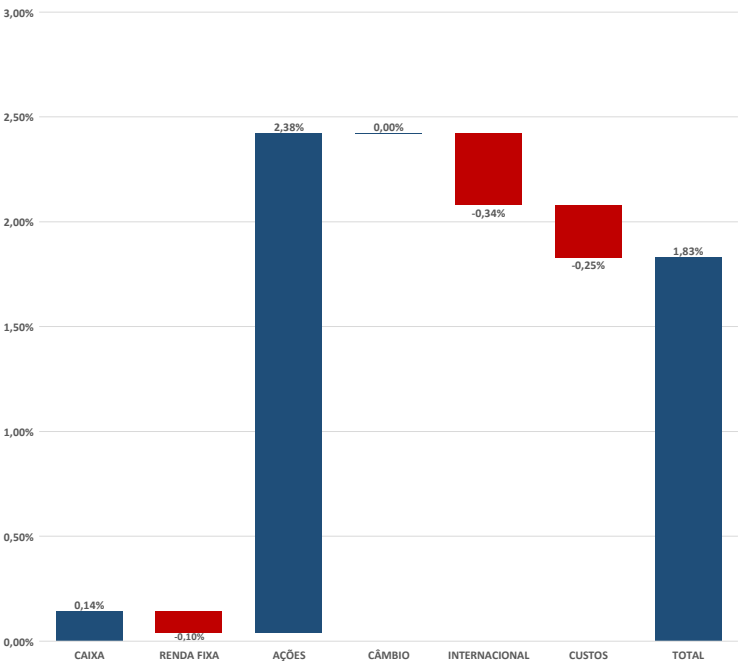
Características Operacionais

PL (R\$):	10.802.362
PL Médio-12 Meses (R\$):	10.406.455
PL Total da Estratégia (R\$):	471.007.360
Taxa de Administração:	2,0% aa
Taxa de Performance:	20% sobre o retorno que exceder o IBOV
Aplicação/Resgate:	Até às 13:00
Cotização de Aplicações:	D+1
Cotização de Resgates:	D+5
Pagamento de Resgates:	D+7
Aplicação Inicial Mínima:	1.000
Movimentação Mínima:	1.000
Saldo Mínimo por Cotista:	1.000
Classificação ANBIMA:	Multimercado Estratégia Macro
Nome do Fundo:	FACT TOTAL RETURN FIF CICM RL
CNPJ:	32.320.740/0001-00
Gestor:	Fact Investments Gestão de Recursos Ltda.
Distribuidores:	Ativa Investimentos, BTG Pactual Digital
Administrador:	Intrag DTVM Ltda.
Custodiante:	Itaú Unibanco S.A.
Contato:	11-3073-0741
Site:	www.factinvest.com.br
Início do Fundo:	31/07/2019 (*)

DISCLAIMER
A FACT INVESTMENTS GESTÃO DE RECURSOS LTDA. ("FACT") não comercializa nem distribui cotas de fundos de investimento ou de qualquer outro ativo financeiro. AS INFORMAÇÕES AQUI CONTIDAS SÃO DE CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO E NÃO SE CONSTITUEM EM QUALQUER TIPO DE ACONSELHAMENTO, SUGESTÃO OU OFERTA DE INVESTIMENTOS, NÃO DEVENDO SER UTILIZADAS COM ESTE PROPÓSITO. Os investidores devem se basear nas informações aqui contidas sem buscar o aconselhamento de um profissional. Nenhuma informação aqui contida é divulgada com o intuito de induzir a compra ou venda de qualquer fundo de investimento gerido pela FACT, ou de qualquer outro valor mobiliário, nem poderá ser entendida como tal em qualquer jurisdição na qual for solicitada, oferecida ou recomendada, sendo considerada ilegítima. OS INVESTIMENTOS EM FUNDOS NÃO CONFEREM CUM A GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, QUALQUER GARANTIA DE CREDITO. - FIC: Sobre o gestor aderido inclui tributação, assim, a previsão ou estimativa de rentabilidade não é líquida de impostos, sendo base de cálculo para a incidência de tributos, que podem ter significativo impacto na rentabilidade final da operação pretendida. As rentabilidades divulgadas não são líquidas de imposto de renda. Nos termos da regulamentação da ANBIMA, para avaliação de performance dos fundos de investimento, é recomendada uma análise de período de, no mínimo, 12 (doze) meses. ALGUNS FUNDOS TEM MENOS DE 12 (DOZE) MESES. PARA AVALIAÇÃO DA PERFORMANCE DE UM FUNDO DE INVESTIMENTO, É RECOMENDÁVEL A ANÁLISE DE, NO MÍNIMO, 12 (DOZE) MESES. A RENTABILIDADE OBTIDA NO PERÍODO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. Investimentos nos fundos de investimento geridos ou administrados pela FACT, assim como em qualquer investimento no mercado financeiro e de capitais, estão sujeitos a riscos de perda de capital e investido. Os investidores devem considerar sempre que o valor de seus investimentos pode aumentar ou diminuir. Além disso, em caso de desvalorização do valor e perda, os investidores podem não recuperar o valor inicial investido. Este fundo de investimento utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento, tais estratégias, da forma como são adotadas, 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 eventual patrimônio negativo dos fundos. A LÍQUIDA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS ENCONTRA-SE DISPONÍVEL NO SITE DO ADMINISTRADOR E NO SITE DA CVM. LÊ-LO E PROCEJA-SE O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR, observado nos links referentes à Política de Investimento, Faltas de Risco e regras para resgate de cotas. A autorização para funcionamento do fundo, pelos membros do conselho de administração, de cotas de fundos de investimento e demais valores mobiliários não implica, por parte da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) ou da ANBIMA, em garantia de veracidade das informações prestadas, de adequação dos respectivos regulamentos e prospectos à legislação vigente ou, ainda, julgamento sobre a qualidade dos fundos e demais valores mobiliários, de seu administrador, gestor e demais prestadores de serviços à CVM e a ANBIMA não respondem pelo desempenho e rentabilidade dos fundos de investimento. A FACT não distribui cotas de fundos de investimento, para avaliação de investimento em fundos é necessário primeiramente consultar o site do administrador, funcionamento e prospectos também se de responsabilidade sobre quaisquer resultados diretos ou indiretos da utilização das informações contidas neste relatório, já que a tomada de decisão de investimento é do cotista. O conteúdo deste material não deverá ser reproduzido, distribuído, publicado ou divulgado sob qualquer pretexto. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. A taxa de administração prevista acima é a taxa de administração mínima do Fundo. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Os fundos multimercado com renda variável podem estar sujeitos a significativa concentração em ativos de países estrangeiros, assim como de desinvestimentos.

Contato: Administrador Intrag Diretores de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ 62.418.140/0003-11) com sede na Cidade e Estado de São Paulo, na Av. Brigadeiro Faria Lima, no 3400 - 10º andar, Bairro Itaim Bibi, CEP 04538-132 Telefone: (11) 2740-2013 <http://www.intrag.com.br/>

Atribuição de Performance do Mês



(*) O fundo MASTER no qual este FIC aplica teve sua classificação alterada para fundo de ações em 05/Julho de 2024, motivo pelo qual passamos a desconsiderar o desempenho anterior à esta data.