

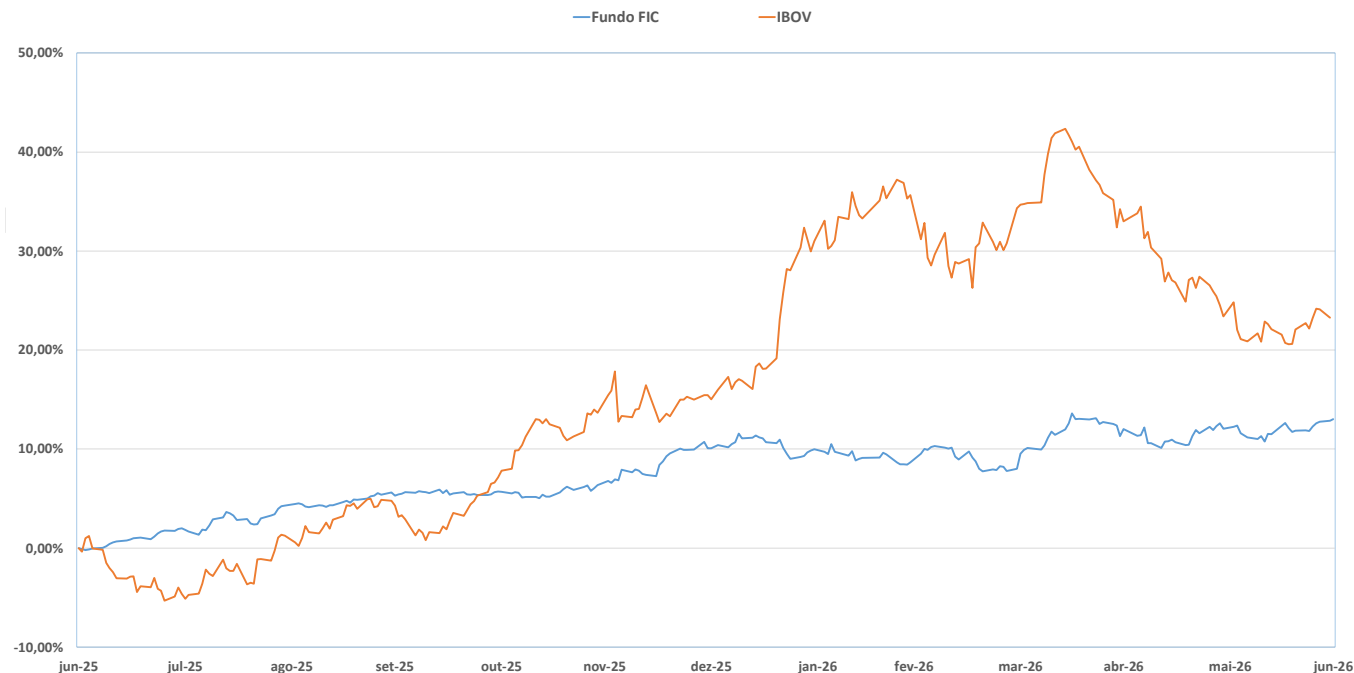
Características do Fundo

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

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INICIO
2024	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%
2025	Fundo	1,03%	1,03%	1,70%	0,16%	3,32%	0,43%	1,83%	2,42%	0,98%	0,34%	0,65%	3,50%	18,76%	7,98%
	IBOV	4,86%	-2,64%	6,08%	3,69%	1,45%	1,33%	-4,17%	6,28%	3,40%	2,26%	6,37%	1,29%	33,95%	27,71%
2026	Fundo	-0,09%	-1,21%	0,80%	2,30%	0,02%	0,86%							2,66%	10,86%
	IBOV	12,56%	4,09%	-0,70%	-0,08%	-7,22%	-1,01%							6,76%	36,35%

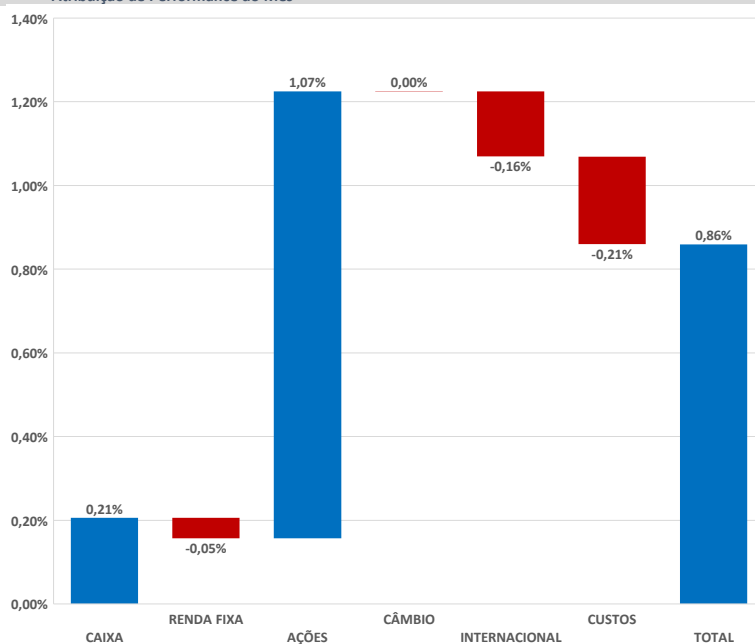
Retorno - 12 Meses



Informações do Fundo

Rentabilidade Acumulada	12 Months	Inception
Fundo	13,02%	10,86%
IBOVESPA	23,89%	36,35%
Volatilidade Anualizada	5,80%	10,83%
Sharpe	-	-
% Meses acima IBOV	50%	35%
Melhor Mês Pior Mês	3,50% / -1,21%	3,50% / -3,37%

Atribuição de Performance do Mês



Características Operacionais

PL (R\$):	11.893.984
PL Médio-12 Meses (R\$):	11.409.913
PL Total da Estratégia (R\$):	397.128.910
Taxa de Administração:	2,0% aa
Taxa de Performance:	20% sobre o retorno que exceder o IBOV
Aplicação/Resgate:	Até as 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 CIM 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:	Itau 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 no Brasil, sendo que a distribuição de cotas de fundos de investimento é realizada exclusivamente por meio de corretoras de valores autorizadas pelo Conselho Federal de Corretores de Valores Mobiliários (CFCV) e pelo Conselho Administrativo de Recursos Fiscais (CARF). A FACT não garante o desempenho futuro dos investimentos e não se responsabiliza por danos decorrentes 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 sujeito a variação de valores 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



(*) 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.