

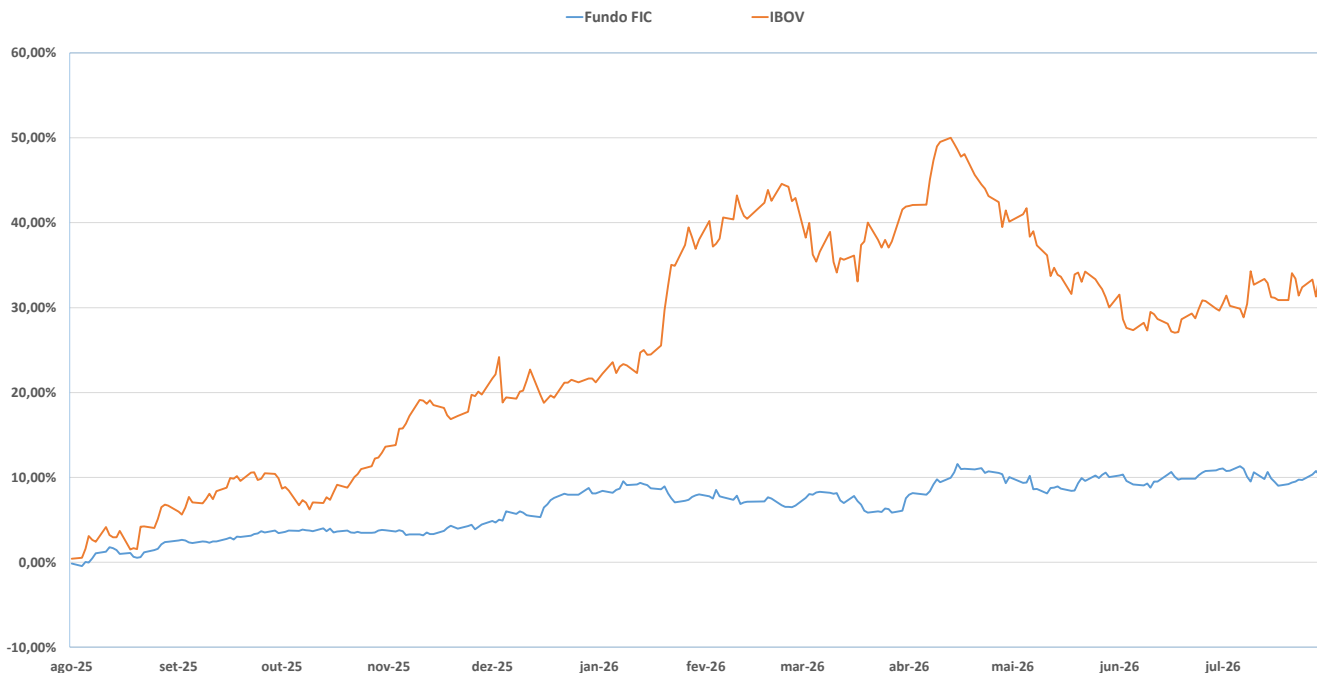
Características do Fundo

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%	-0,33%						2,32%	10,49%
	IBOV	12,56%	4,09%	-0,70%	-0,08%	-7,22%	-1,01%	3,47%						10,47%	41,09%

Retorno - 12 Meses



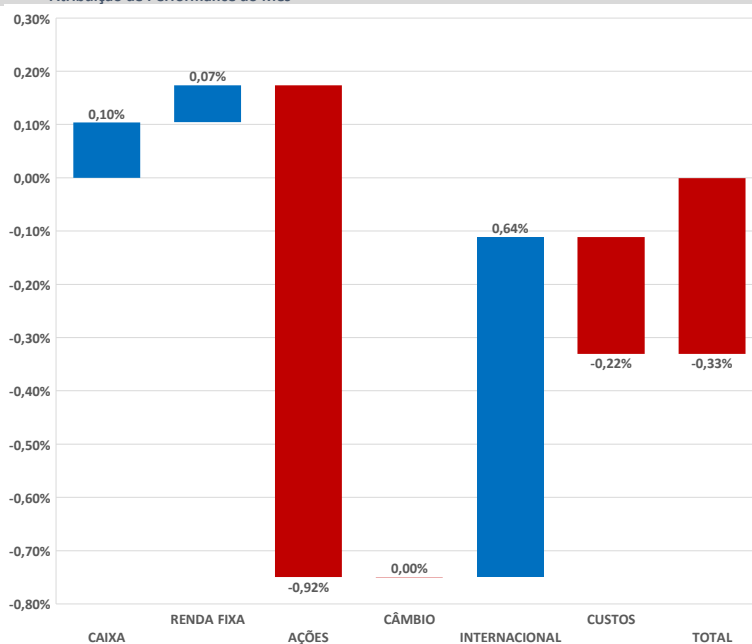
Informações do Fundo

Rentabilidade Acumulada	12 Months	Inception
Fundo	10,62%	10,49%
IBOVESPA	34,06%	41,09%
Volatilidade Anualizada	6,24%	10,80%
Sharpe	-	-
% Meses acima IBOV	42%	40%
Melhor Mês Pior Mês	3,50% / -1,21%	3,50% / -3,37%

Características Operacionais

PL (R\$):	11.958.336
PL Médio-12 Meses (R\$):	11.520.552
PL Total da Estratégia (R\$):	405.877.013
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:	Itaú Unibanco S.A.
Contato:	11-3073-0741
Site:	www.factinvest.com.br
Início do Fundo:	31/07/2019 (*)

Atribuição de Performance do Mês



DISCLAIMER

A FACT INVESTMENTS GESTÃO DE RECURSOS LTDA. ("FACT") não recomenda nem distribui cotas de fundos de investimento no qual quer 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 COMO ESTE PROPÓSITO. Os investidores não devem se basear nas informações aqui contidas para tomar decisões de investimento. Nenhuma informação aqui contida é divulgada com o intuito de recomendar ou sugerir a compra ou venda de cotas de qualquer fundo de investimento emitido pela FACT, ou de qualquer outro ativo financeiro, nem poderá ser entendida como tal em qualquer jurisdição na qual for utilizada, oferecida ou reproduzida de qualquer maneira. OS INVESTIMENTOS EM FUNDOS NÃO CONTAM COM A GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, ANDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. Sobre os ganhos auferidos sobre a venda, assim, a previsão de rentabilidade não é ligada à rentabilidade real, sendo base de cálculo para a rentabilidade da venda, que podem ter significativo impacto na rentabilidade final da operação pretendida. As rentabilidades divulgadas aqui são apenas para fins informativos. Não há garantia de que o fundo de investimento de fato realize os resultados aqui divulgados. A rentabilidade aqui divulgada não é uma 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 do capital investido. Os investidores devem considerar sempre que o valor de seus investimentos pode aumentar ou diminuir. Além disso, em caso de distribuição do valor e perdas, os investidores podem não receber o valor total investido. Este fundo de investimento utiliza derivativos como parte integrante de sua estratégia de investimento, de forma como não atrelados, podem resultar em significativas perdas potenciais para os cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir eventuais perdas dos fundos. A LAMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS ENCONTRA-SE DISPONÍVEL NO SITE DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, NA COTA DA COTA, E O PROSPECTO E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR, SUBMETIDO NAS FORMAS REFERENTES À Política de Investimento. Fatores de Risco e regras para resgate de cotas. A autorização para funcionamento e/ou venda, pelos membros do sistema de distribuição, 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, pagamento sobre a qualidade dos fundos e demais valores mobiliários, de sua administração, gestão 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 entrar em contato com o administrador do fundo. A FACT, sua administração, funcionários e prestadores de serviços não se responsabilizam sobre quaisquer danos resultantes direta ou indiretamente 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 LIGADA AOS IMPÓSTOS. 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 multimercados com renda variável podem estar sujeitos a significativa concentração em ativos de países emergentes, com os riscos daí decorrentes.

Controladora Administradora: Intrag Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ 02.418.140/0001-31) com sede na Cidade e Estado de São Paulo, na Av. Brigadeiro Faria Lima, no 3400 - 10º andar, Bairro Itaim Bibi, CEP: 04538-317 e/ou (11) 3740-1013 <http://www.intrag.com.br/>.

(*) 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 a esta data.