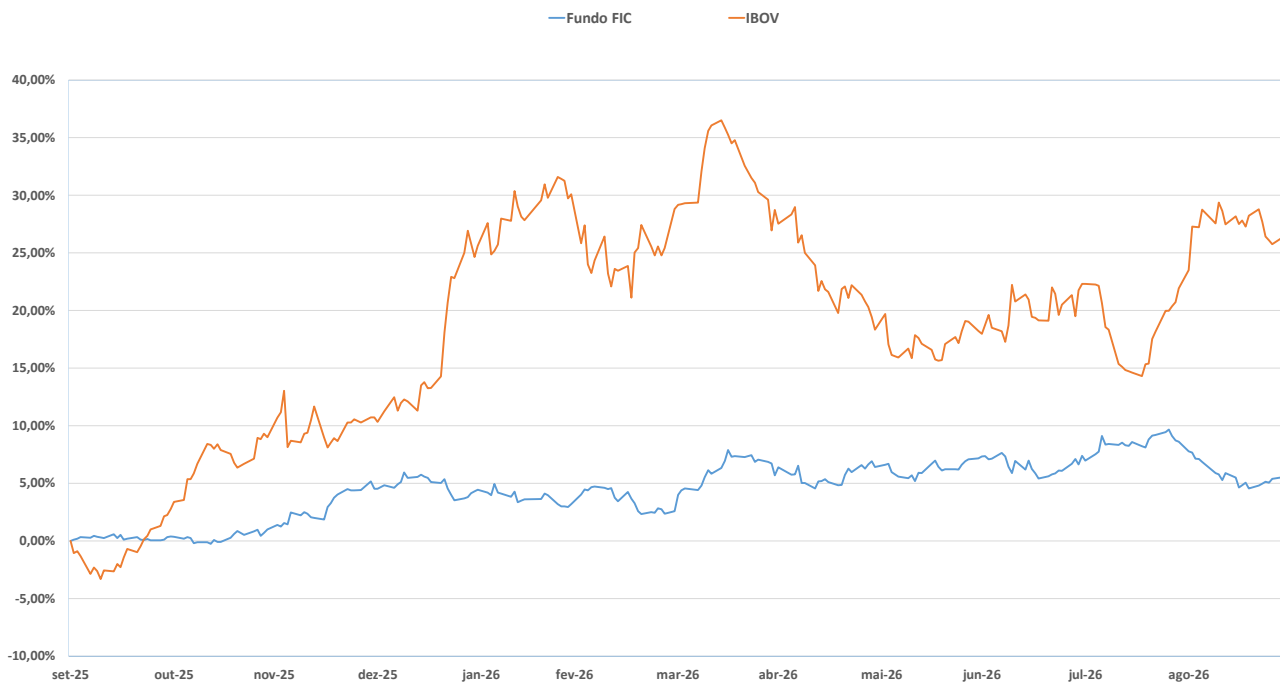


Objetivo: Obter retornos superiores ao IBOVESPA, consistentes e descorrelacionados no longo prazo, por meio de carteira diversificada de investimentos ajustada ao mandato de risco definido.

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%	0,75%	-2,02%				1,00%	9,06%
	IBOV	12,56%	4,09%	-0,70%	-0,08%	-7,22%	-1,01%	3,47%	-0,33%	5,03%				15,65%	47,70%

Retorno - 12 Meses



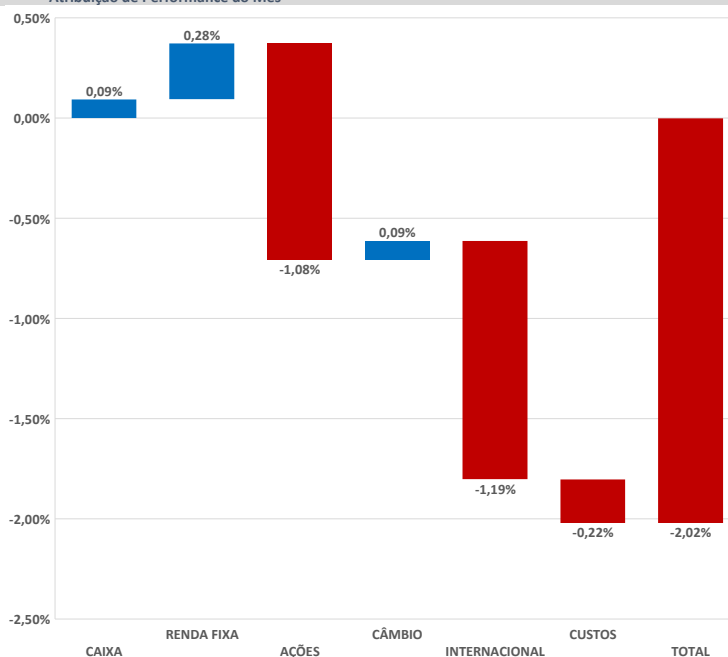
Informações do Fundo

Rentabilidade Acumulada	12 Months	Inception
Fundo	5,60%	9,06%
IBOVESPA	27,48%	47,70%
Volatilidade Anualizada	6,59%	10,72%
Sharpe	-	-
% Meses acima IBOV	50%	41%
Melhor Mês 1 Pior Mês	3,50% / -2,02%	3,50% / -3,37%

Características Operacionais

PL (R\$):	11.803.777
PL Médio-12 Meses (R\$):	11.683.646
PL Total da Estratégia (R\$):	379.067.422
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 CIMM RL
CNPJ:	32.320.740/0001-00
Gestor:	Fact Investments Gestão de Recursos Ltda.
Distribuidores:	Ativa Investimentos, BTG Pactual Digital
Administrador:	Intrag DTM 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

[illegible]

(*) 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