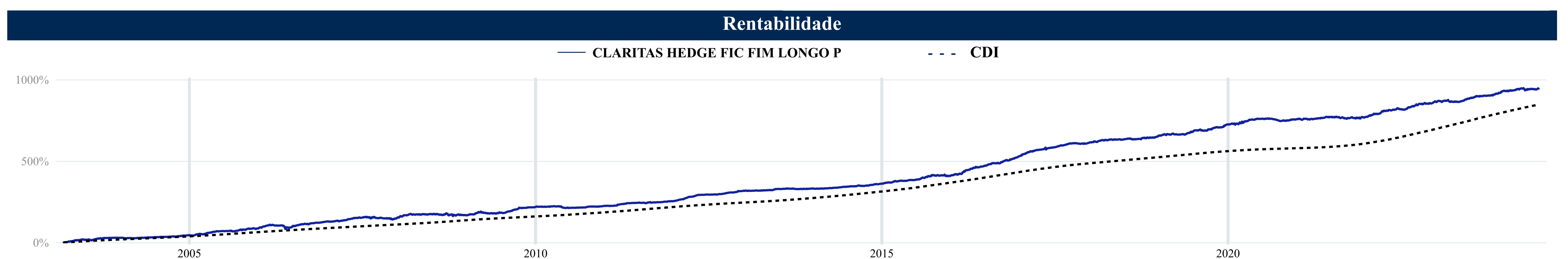


CLARITAS HEDGE FIC FIM LONGO P

junho de 2024

| Informações Gerais | | Dados | |
|--|---|---|---|
| Data de Início | 11/03/2003 | Valor da cota em 28/06/2024 | 10,4428352 |
| Taxa de Administração ² | 1.50% a.a. (máxima de 2,00 % a.a.) | Patrimônio Líquido | R\$ 4.760.164,06 |
| Taxa de Performance | 20% a.a. sobre o que exceder do CDI | PL Médio 12 meses ¹ | R\$ 6.990.657,06 |
| Aplicação Cotização | D+0 (fechamento) | Informações Adicionais | |
| Aplicação Liquidação | D+0 (fechamento) | Gestor | Claritas Administração de Recursos LTDA |
| Resgate Cotização | D+3 (3 ° d.u. após o pedido de resgate) | Administrador | BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. |
| Resgate Liquidação | D+7 (4° d.u. . após a cotização do resgate) | Custodiante | BNY Mellon Banco S.A ¹ |
| Taxa de Saída | Não se aplica | Objetivos do Fundo e Política de Investimento | |
| Horário de movimentação ⁴ | Solicitação até às 14:30h | A política de investimento do FUNDO consiste em aplicar, no mínimo, 97% (noventa e sete por cento) de seu patrimônio líquido em cotas do CLARITAS HEDGE MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO LONGO PRAZO, inscrito no CNPJ sob o nº 12.219.403/0001-05 ("Fundo Master"), administrado pelo ADMINISTRADOR e gerido pela GESTORA, cuja política de investimento consiste em atingir o objetivo de investimento do FUNDO pela identificação, por meio de uma análise conjunta da situação macroeconômica e política no Brasil e do mundo, de grandes tendências de mercado. | |
| Aplicação inicial | R\$ 1,000.00 (mil reais) | Público Alvo | |
| Movimentação Mínima | R\$ 1,00 (um real) | O FUNDO tem como público alvo investidores em geral que não requeiram liquidez imediata e estejam de acordo com os objetivos de rentabilidade de longo prazo. Os investidores também devem compreender e estar dispostos a assumir todos os riscos inerentes a política de investimento do Fundo. | |
| Saldo Mínimo | R\$ 1,000.00 (mil reais) | Integração das Questões ASG | |
| Favorecido: CLARITAS HEDGE FIC FIM LONGO P CNPJ: 05.488.919/0001-90 BANCO BNY MELLON S.A. - 017 Agência: 1 Conta Corrente: 1644-6 | | Não se aplica | |
| Classificação ANBIMA | Multimercados Macro | | |
| Código ANBIMA | 113190 | | |
| Bloomberg | CLHDG30 BZ | | |
| ISIN | BRCL30CTF000 | | |
| CNPJ | 05.488.919/0001-90 | | |
| Tributação ⁵ | Longo Prazo | | |



Retornos mensais

| | | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Ano | Desde Início |
|------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------------|
| 2003 | FUNDO | -- | -- | 2.23% | 6.88% | 4.89% | 1.21% | -1.42% | 5.88% | 2.92% | 2.39% | 0.75% | -0.02% | 28.52% | 28.52% |
| | %CDI | | | 1.71% | 3.69% | 2.50% | 66% | - | 33.2% | 1.74% | 1.46% | 5.6% | - | 15.7% | 15.7% |
| 2004 | FUNDO | -2.11% | 0.83% | 0.21% | 1.15% | 1.53% | 1.00% | 1.38% | 0.67% | 0.78% | 0.95% | 3.45% | 2.43% | 12.89% | 45.09% |
| | %CDI | - | 7.7% | 1.5% | 9.8% | 12.5% | 8.2% | 10.8% | 5.2% | 6.3% | 7.8% | 2.76% | 1.65% | 8.0% | 12.1% |
| 2005 | FUNDO | -0.13% | 5.74% | 1.03% | 4.49% | 4.30% | 0.95% | 0.44% | -0.78% | 5.37% | 1.14% | 2.51% | 0.65% | 28.61% | 86.59% |
| | %CDI | - | 4.73% | 6.8% | 3.19% | 2.87% | 6.0% | 2.9% | - | 3.58% | 8.1% | 1.82% | 4.4% | 1.51% | 13.7% |
| 2006 | FUNDO | 6.23% | 3.55% | -0.85% | 0.57% | -8.11% | 6.20% | 3.57% | 3.01% | 1.03% | 2.55% | 1.22% | 2.33% | 22.54% | 128.65% |
| | %CDI | 4.36% | 3.12% | - | 5.2% | - | 5.24% | 3.05% | 2.40% | 9.8% | 2.33% | 1.19% | 2.36% | 1.50% | 1.46% |
| 2007 | FUNDO | -0.02% | 1.32% | 1.97% | 3.03% | 3.06% | 0.27% | 2.11% | -0.61% | -2.04% | -1.01% | -1.76% | 1.65% | 8.09% | 147.15% |
| | %CDI | - | 1.52% | 1.88% | 3.22% | 3.00% | 3.0% | 2.18% | - | - | - | - | 1.97% | 6.8% | 1.34% |
| 2008 | FUNDO | 5.11% | 3.41% | 1.43% | 0.35% | -0.30% | 0.81% | -0.42% | -1.75% | 0.57% | -1.10% | 0.18% | -0.33% | 8.04% | 167.02% |
| | %CDI | 5.54% | 4.29% | 1.70% | 3.9% | - | 8.6% | - | 5.2% | - | 1.8% | - | - | 6.5% | 12.3% |
| 2009 | FUNDO | 2.26% | 2.79% | 1.63% | -2.24% | 0.06% | 1.02% | 1.22% | 2.98% | 4.04% | 2.23% | 0.93% | 0.57% | 18.79% | 217.19% |
| | %CDI | 2.16% | 3.28% | 1.68% | - | 8% | 1.35% | 1.55% | 4.32% | 5.84% | 3.23% | 1.40% | 7.8% | 1.90% | 1.36% |
| 2010 | FUNDO | 0.71% | -0.40% | 0.96% | 0.29% | -2.68% | -0.23% | 0.11% | 0.51% | 1.15% | 0.65% | -0.37% | 1.55% | 2.19% | 224.13% |
| | %CDI | 1.07% | - | 1.27% | 4.4% | - | - | 1.2% | 5.8% | 1.36% | 8.0% | - | 1.67% | 2.2% | 1.2% |
| 2011 | FUNDO | -0.10% | 0.78% | 2.85% | 1.66% | 0.47% | 0.50% | -0.32% | 1.24% | -0.37% | 0.47% | 1.16% | 0.49% | 9.14% | 253.75% |
| | %CDI | - | 9.2% | 3.11% | 1.98% | 4.8% | 5.3% | - | 1.16% | - | 5.4% | 1.35% | 5.4% | 7.9% | 1.16% |
| 2012 | FUNDO | 2.52% | 1.77% | 2.98% | 2.30% | 0.95% | 0.30% | 0.24% | 0.54% | 1.09% | 1.43% | 0.95% | 1.32% | 17.63% | 316.13% |
| | %CDI | 2.84% | 2.39% | 3.68% | 3.27% | 1.30% | 4.7% | 3.6% | 7.8% | 2.02% | 2.36% | 1.74% | 2.46% | 2.10% | 1.29% |
| 2013 | FUNDO | 0.28% | 0.21% | 0.10% | 0.39% | 0.42% | 1.46% | 0.17% | 0.48% | -0.45% | -0.04% | 0.04% | 0.63% | 3.73% | 331.67% |
| | %CDI | 4.8% | 4.3% | 1.8% | 6.4% | 7.2% | 2.46% | 2.4% | 6.9% | - | - | 6% | 8.1% | 4.6% | 1.22% |
| 2014 | FUNDO | -0.40% | 0.17% | 0.54% | 0.69% | 0.72% | 0.56% | 0.78% | 0.80% | -0.43% | 1.25% | 1.20% | 0.70% | 6.78% | 360.93% |
| | %CDI | - | 2.1% | 7.1% | 8.5% | 8.4% | 6.9% | 8.3% | 9.3% | - | 1.32% | 1.43% | 7.4% | 6.3% | 1.15% |
| 2015 | FUNDO | 1.43% | 0.61% | 1.44% | 0.22% | 0.98% | 0.35% | 2.22% | 1.36% | 2.52% | -0.89% | 1.27% | -1.21% | 10.73% | 410.41% |
| | %CDI | 1.54% | 7.5% | 1.39% | 2.4% | 1.00% | 3.3% | 1.89% | 1.23% | 2.27% | - | 1.21% | - | 8.1% | 1.12% |
| 2016 | FUNDO | 1.86% | 0.06% | 4.75% | 2.46% | 0.57% | 1.85% | 1.79% | 0.65% | 1.35% | 1.66% | 2.11% | 2.15% | 23.36% | 529.65% |
| | %CDI | 1.76% | 6% | 4.09% | 2.33% | 5.2% | 1.59% | 1.62% | 5.3% | 1.22% | 1.58% | 2.03% | 1.92% | 1.67% | 1.22% |
| 2017 | FUNDO | 2.43% | 2.05% | 1.38% | 0.65% | 1.18% | 0.72% | 1.37% | 0.92% | 1.05% | 0.02% | -0.30% | 0.83% | 12.97% | 611.33% |
| | %CDI | 2.24% | 2.36% | 1.31% | 8.2% | 1.27% | 8.8% | 1.71% | 1.15% | 1.63% | 4% | - | 1.53% | 1.30% | 1.26% |
| 2018 | FUNDO | 1.22% | 0.62% | 0.73% | 0.35% | -0.13% | 0.14% | 0.55% | -0.51% | 0.24% | 1.15% | 0.20% | 1.02% | 5.72% | 652.05% |
| | %CDI | 2.09% | 1.33% | 1.37% | 6.8% | - | 2.7% | 1.02% | - | 5.2% | 2.13% | 4.1% | 2.06% | 8.9% | 1.25% |
| 2019 | FUNDO | 1.71% | -0.34% | 0.17% | -0.01% | 0.80% | 1.37% | 0.94% | -0.09% | 1.09% | 1.37% | - | 2.17% | 9.54% | 723.76% |
| | %CDI | 3.15% | - | 3.6% | - | 1.47% | 2.92% | 1.65% | - | 2.34% | 2.86% | - | 5.76% | 1.60% | 1.29% |
| 2020 | FUNDO | 0.35% | 0.06% | 1.86% | 1.26% | 0.49% | 0.29% | 0.09% | -0.52% | -1.07% | -0.08% | 0.65% | 0.66% | 4.08% | 757.34% |
| | %CDI | 9.3% | 1.9% | 5.47% | 4.41% | 2.07% | 1.33% | - | - | - | - | 4.33% | 4.01% | 1.47% | 1.31% |
| 2021 | FUNDO | -0.41% | 0.16% | 0.45% | 0.40% | 0.67% | 0.21% | 0.03% | -0.48% | -0.38% | 0.16% | -0.36% | 1.19% | 1.62% | 771.19% |
| | %CDI | - | 1.16% | 2.27% | 1.93% | 2.50% | 6.9% | 8% | - | - | 3.2% | - | 1.55% | 3.7% | 1.27% |
| 2022 | FUNDO | 1.22% | 0.79% | 1.72% | 0.99% | 0.19% | 0.31% | 0.30% | 1.53% | 1.03% | 0.77% | 0.40% | 1.25% | 11.00% | 866.98% |
| | %CDI | 1.67% | 1.05% | 1.86% | 1.18% | 1.9% | 3.1% | 2.9% | 1.31% | 1.2% | 7.5% | 3.9% | 1.11% | 8.9% | 1.25% |
| 2023 | FUNDO | -0.04% | 0.29% | -0.64% | -0.09% | 0.81% | 1.60% | 1.01% | 0.23% | 0.40% | 0.03% | 1.47% | 1.47% | 6.71% | 931.87% |
| | %CDI | - | 3.2% | - | - | 7.2% | 1.49% | 9.4% | 2.0% | 4.1% | 3% | 1.60% | 1.64% | 5.1% | 1.16% |
| 2024 | FUNDO | 0.19% | 0.32% | 0.89% | -0.86% | 0.40% | 0.26% | - | - | - | - | - | - | 1.20% | 944.28% |
| | %CDI | 1.9% | 4.0% | 1.07% | - | 4.9% | 3.3% | - | - | - | - | - | - | 2.3% | 1.11% |

Estatísticas

| | % Acum. | %CDI | Meses positivos | 207 |
|--|---------|--------|---------------------------|--------|
| Últimos 12 meses | 5,95 | 50,88 | Meses negativos | 49 |
| Últimos 24 meses | 13,81 | 51,49 | Meses acima de benchmark | 119 |
| Últimos 36 meses | 20,02 | 52,98 | Meses abaixo do benchmark | 137 |
| Desde o início | 944,28 | 111,47 | Maior retorno mensal | 6,88% |
| Retorno médio mensal (desde o início) ³ | 0,93 | | Menor retorno mensal | -8,11% |
| Volatilidade diária anualizada (12 meses) | 1,96 | | | |
| Índice de sharpe (12 meses) | -2,58 | | | |

| Gestora | Administrador |
|---|---|
| Principal Claritas Av. Brigadeiro Faria Lima, 4221 4º andar 04538-133 São Paulo - SP t + 55 11 2131-4900 e-mail: claritas@claritas.com.br www.claritas.com.br | BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. (CNPJ 02.201.501/0001-61) Av. Presidente Wilson, 231, 11º andar, Rio de Janeiro, RJ - CEP 20030-905 t + 55 (21) 3219-2998 sac@bnymellon.com.br ou (21) 3974-4600, (11) 3050-8010, 0800 725 3219 Ouvidoria: ouvidoria@bnymellon.com.br ou 0800 7253219 www.bnymellon.com.br/sf |

¹ Valor da média aritmética da soma do patrimônio líquido apurado no último dia útil de cada mês, nos 12 (doze) meses anteriores. ² A taxa de administração prevista no caput é a taxa de administração mínima do fundo. A Taxa de Administração acima indicada não compreende as taxas de administração cobradas pelos fundos de investimento e/ou fundos de investimento em cotas de fundos de investimento conforme definido na legislação vigente. ³ Média da rentabilidade mensal desde o início do fundo. ⁴ O horário limite de liquidação é 17h30 para TED e CETIP. O horário de entrada das ted's para aplicação é 15h. Em 08/12/2011 o Fundo Claritas Hedge 30 FIC FIM LP (CNPJ 05.488.919/0001-9) incorporou o Fundo Claritas Hedge FIC FIM LP (CNPJ 03.310.657/0001-43) e teve seu nome alterado para Claritas Hedge FIC FIM LP. Em 27/12/2011 o administrador do Fundo Claritas Hedge FIC FIM (CNPJ 05.488.919/0001-90) passou a ser o BNY Mellon Serviços Financeiros. Em 27/12/2011 o Fundo Claritas Hedge FIC FIM (CNPJ 05.488.919/0001-9) incorporou o Fundo Claritas Hedge 30 FIC FIM (CNPJ 11.228.424/0001-24). Em 07/05/2021, o Fundo Claritas Hedge FIC FIM (CNPJ 05.488.919/0001-90), foi cindido, sendo a parcela cindida incorporada no Fundo Claritas Hedge Advisory FIC FIM LP (CNPJ 39.960.120/0001-76). Utiliza-se como metodologia para o cálculo de rentabilidade as últimas cotas dos meses de referência dos períodos. Leia o formulário de informações complementares, a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Tais documentos encontram-se disponíveis no site do administrador (https://servicosfinanceiros.bnymellon.com/AppPages/investmentfunds/funds.aspx). A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Os fundos multimercados com renda variável podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O fundo pode utilizar 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 o prejuízo dos fundos. As informações contidas nesse material são de caráter exclusivamente informativo. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Claritas Administração de Recursos Ltda ("Principal Asset Management") não se responsabiliza por ganhos e perdas consequentes do uso deste informativo. Este material não pode ser copiado, reproduzido ou distribuído sem a prévia e expressa concordância da Principal Asset Management 5 Não se aplica