

DESCRIÇÃO

O fundo busca obter rentabilidade superior ao CDI através de estratégias com instrumentos de renda variável, com exposição primordialmente em Brasil complementadas por exposições em bolsas globais e ações de América Latina. Os investimentos são realizados a partir de uma sólida abordagem macroeconômica combinada com uma completa análise fundamentalista, além de uma rigorosa avaliação dos riscos envolvidos.

| ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE | 2022 (%) | DESDE O INÍCIO (%) |
|---------------------------|--------------|--------------------|
| Direcional Ações | -3.83 | -4.46 |
| Brasil | -3.10 | -3.39 |
| Global | 1.25 | 1.31 |
| Latam | -1.97 | -2.38 |
| Valor Relativo | -1.81 | -1.46 |
| Tático | 0.05 | 0.05 |
| Quant | 0.38 | 0.38 |
| Taxas e Custos | -1.61 | -2.26 |
| CDI | 6.49 | 7.93 |
| Total | -0.34 | 0.18 |

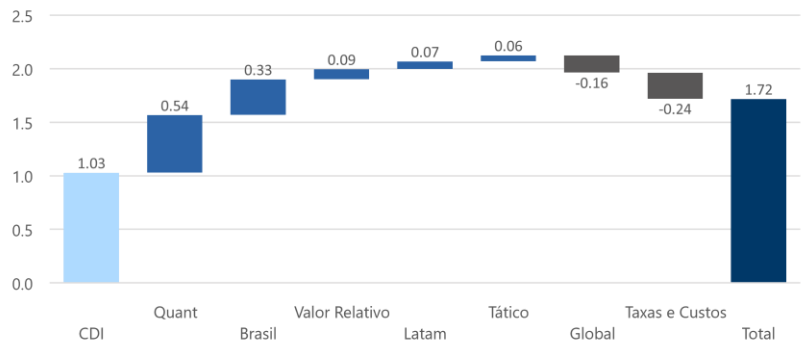
RENTABILIDADE (%)

| Mês | Ano | Desde o início |
|------|-------|----------------|
| 1.72 | -0.34 | 0.18 |

RISCO

| |
|------------------------|
| Volatilidade Realizada |
| 6.07% a.a. |

ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE NO MÊS (%)



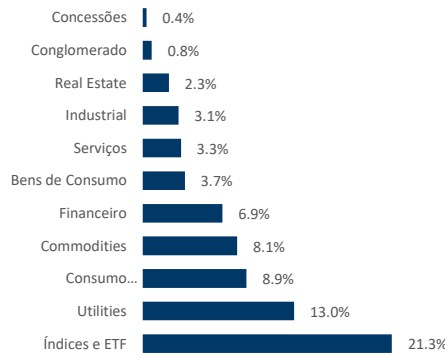
ANÁLISE DE LIQUIDEZ

| Market Cap | Liquidez | | |
|----------------------|----------|-----------------------|-------|
| < R\$ 5 bi | 8.7% | < R\$ 10 mm | 0.9% |
| R\$ 5 bi a R\$ 10 bi | 6.2% | R\$ 10 mm a R\$ 50 mm | 13.7% |
| > R\$ 10 bi | 35.5% | > R\$ 50 mm | 35.9% |

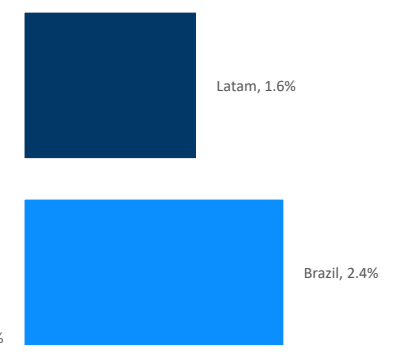
EXPOSIÇÃO NO PERÍODO

| | Mês |
|-------------|--------|
| Bruta | 72.0% |
| Líquida | 3.9% |
| Gross Long | 37.9% |
| Gross Short | -34.0% |

EXPOSIÇÃO SETORIAL³



EXPOSIÇÃO GEOGRÁFICA²



RENTABILIDADE HISTÓRICA

| | jan | fev | mar | abr | mai | jun | jul | ago | set | out | nov | dez | ano | desde o início |
|--------------|--------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|-----|-----|-----|--------|-------|--------|----------------|
| 2021 | | | | | | | | | | | | | | |
| Fundo | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | -2.42% | 3.02% | 0.52% | 0.52% |
| CDI | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0.59% | 0.76% | 1.35% | 1.35% |
| 2022 | | | | | | | | | | | | | | |
| Fundo | -0.13% | -1.49% | 0.92% | 0.60% | -2.37% | 0.48% | 1.72% | - | - | - | - | - | -0.34% | 0.18% |
| CDI | 0.73% | 0.75% | 0.92% | 0.83% | 1.03% | 1.01% | 1.03% | - | - | - | - | - | 6.49% | 7.93% |

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

| Macro Capital Gestão de Recursos | Multimercado Long & Short Direcional | 29-Oct-21 | D+0 | D+29 / D+30 | R\$ 9,063 Mi |
|----------------------------------|--------------------------------------|------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|
| GESTOR | ESTRATÉGIA | DATA DE INÍCIO | COTA DE APLICAÇÃO | COTA DE RESGATE | PATRIMÔNIO LÍQUIDO |
| Banco Itaú / INTRAG | Investidores em Geral | R\$ 5,000.00 | R\$ 1,000.00 | R\$ 5,000.00 | R\$ 7,457 Mi |
| CUSTODIANTE & ADMINISTRADOR | PÚBLICO ALVO | APLICAÇÃO MÍNIMA | MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA | SALDO DE PERMANÊNCIA MÍNIMO | PL MÉDIO ¹ |
| 41.569.874/0001-41 | Longo Prazo | 100% CDI | 2.0% a.a. | 20% do que exceder o CDI | R\$ 9,055 Mi |
| CNPJ | CLASSIFICAÇÃO TRIBUTÁRIA | BENCHMARK | TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | TAXA DE PERFORMANCE | PL MASTER |



A Macro Capital não comercializa nem distribui cotas de fundos de investimentos. Para investir em nossos fundos, contate um distribuidor autorizado. A Macro Capital não se responsabiliza por erros, omissões ou imprecisões no conteúdo das informações divulgadas, nem por decisões de investimento tomadas com base neste site. As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo e não constituem nenhum tipo de aconselhamento de investimentos. Recomendamos uma consulta a assessores de investimento e profissionais especializados para uma análise específica e personalizada, antes de sua decisão sobre investimentos. Fundos de investimento não contam com nenhum mecanismo de seguro e nem garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, ou, ainda, do fundo garantidor de créditos - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Os fundos Macro Capital, através de suas estratégias de investimento, podem estar sujeitos a diversos riscos inerentes ao negócio, como concentração de ativos de um mesmo emissor e alta exposição a derivativos e investimentos fora do país. Essas estratégias podem resultar em significativas perdas patrimoniais, podendo, inclusive, acarretar perdas superiores ao capital aplicado e consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo dos fundos. A rentabilidade apresentada dos fundos não é líquida de impostos.