

# RUBIK CICLOS FIC FIM

LÂMINA DE INFORMAÇÕES

AGO | 2024



## PÚBLICO ALVO

O fundo é destinado para investidores em geral, que buscam exposição em empresas, índices, títulos de renda fixa, *commodities* e moedas, que se apreciem conforme o ciclo econômico. O veículo aloca seu patrimônio no Rubik Ciclos Master FIM com horizontes de investimento de longo prazo.

## OBJETIVO DO FUNDO

O Rubik Ciclos FIC FIM faz a alocação em renda variável e renda fixa, utilizando indicadores macroeconômicos para investimento e balanceamento tanto no mercado brasileiro como no exterior. O fundo tem por objetivo maximizar o retorno ajustado ao risco com diversificação global de renda variável, focado em clientes moderados com menor tolerância a risco, tendo VAR95 de 1,0% e VAR99 de 1,6%, resultando em volatilidade máxima aproximada de 10% a.a. Desta maneira, é permitido o uso de derivativos para controle de risco e exposição do fundo.

## INFORMAÇÕES GERAIS

Data de Início	Julho/2022
Classificação Anbima	Multimercado
Código Anbima	662909
Benchmark	CDI
Taxa de administração	2%
Taxa de saída antecipada	-
Taxa de performance	20%/CDI
Tributação	Longo prazo
Custodiante	B3
Administrador	BTG Pactual
Auditoria	EY
Gestão	Rubik Capital
CNPJ Fundo	46.929.855/0001-00

## INDICADORES

Valor da Cota	1,30628840
PL do fundo	61.996.365
PL Médio (12 meses)	50.860.000
Retorno anualizado	14,1%
Retorno acumulado do fundo	30,6%
Retorno acumulado do CDI	27,1%
Meses positivos	23
Meses negativos	2
Índice de Sharpe	0,5
Volatilidade anualizada	3,7%
PL do Fundo Master	66.429.680

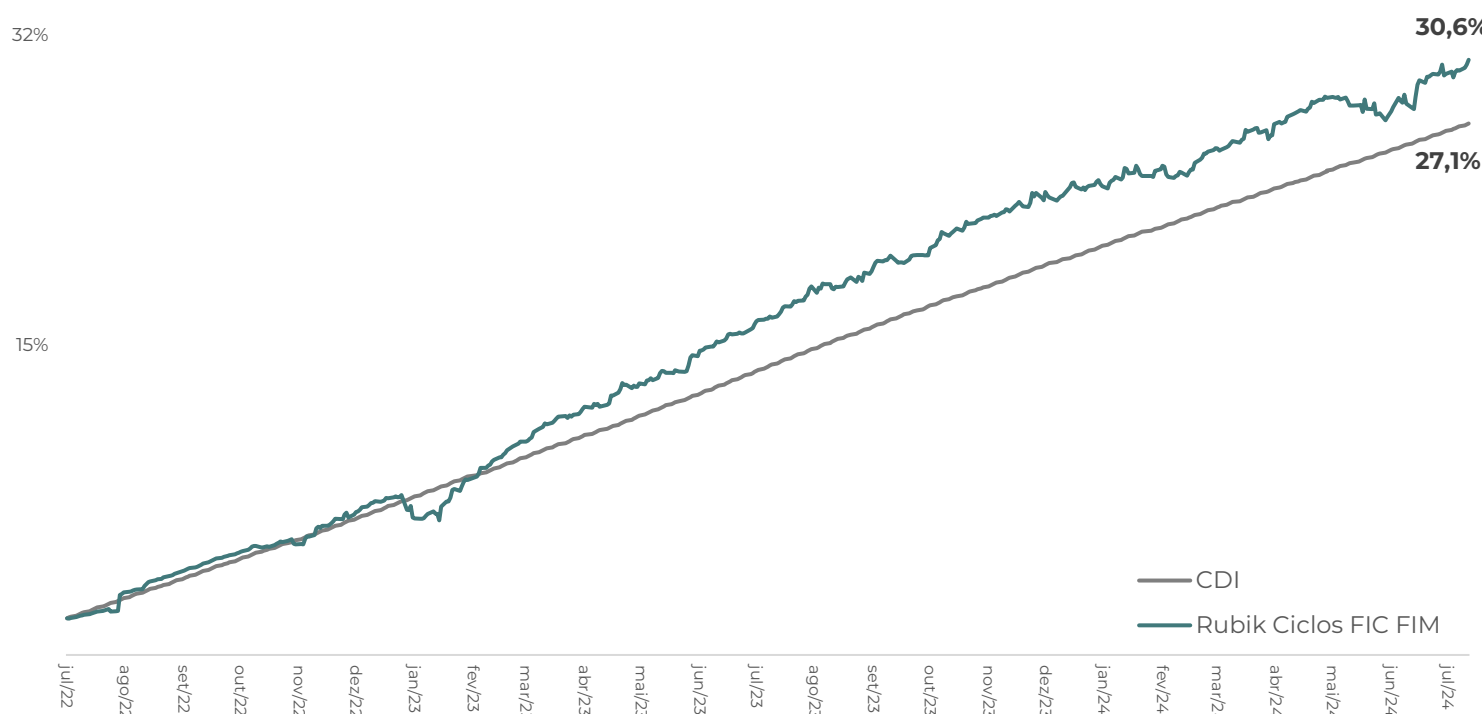
## MOVIMENTAÇÕES

Horário limite Movimentações	14h30
Investimento inicial mínimo	R\$ 5.000
Movimentação adicional mínima	R\$ 1.000
Saldo Mínimo de Permanência	R\$ 3.000
Cota	Fechamento
Cotização de aplicação	D+0
Cotização de Resgate	D+30

## RISCO

Máximo <i>drawdown</i>	-1,3%
<i>Drawdown</i> atual	-
<i>Value At Risk</i> 95% histórico	0,3%
Volatilidade anualizada	3,7%
% do fundo - 5 maiores posições	30,8%
Prazo estimado para liquidação	6 dias
<i>Duration</i> da carteira de crédito	5,8

## EVOLUÇÃO DA RENTABILIDADE



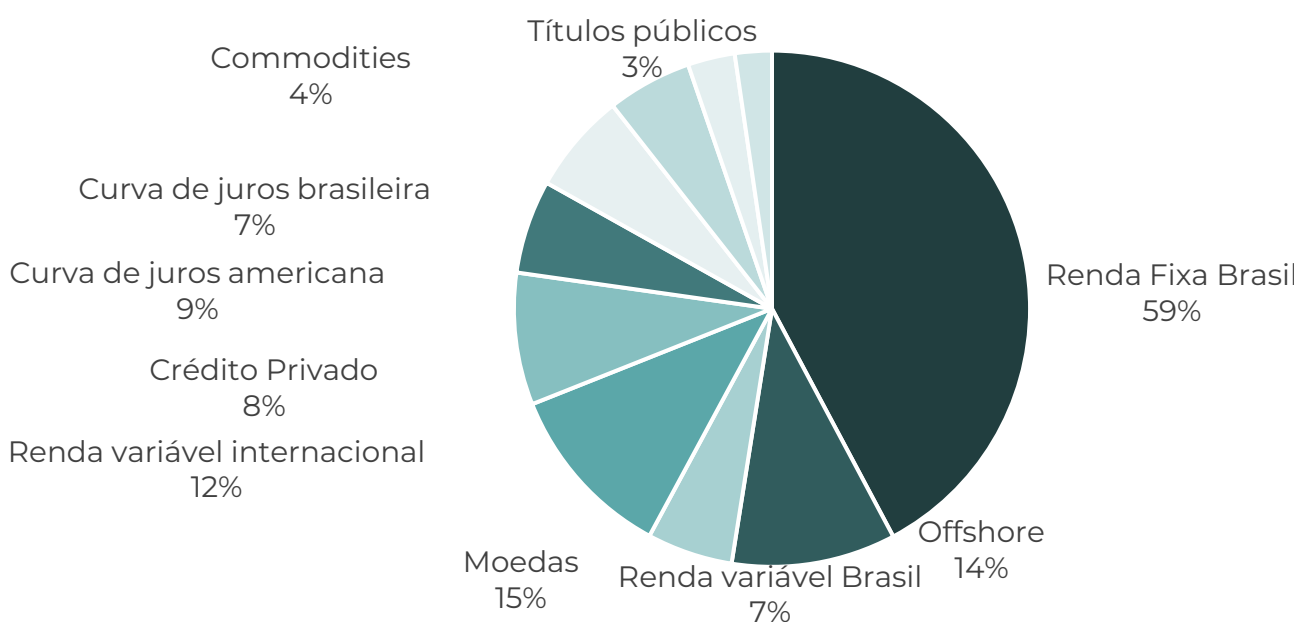
\*Dados referentes ao dia 17/05/2024

## RENTABILIDADE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INICIO
2022							0,2%	1,6%	1,1%	0,9%	1,1%	1,3%	6,4%	6,4%
%CDI							58%	142%	103%	84%	106%	119%	109%	109%
2023	-0,6%	2,5%	2,1%	0,9%	1,8%	1,4%	1,2%	1,4%	1,4%	1,0%	1,1%	0,6%	15,7%	23,2%
%CDI	-57%	272%	177%	96%	157%	128%	115%	123%	148%	101%	119%	68%	121%	117%
2024	1,2%	-0,2%	1,3%	1,2%	0,3%	0,1%	1,9%						6,1%	30,6%
%CDI	129%	-20%	161%	137%	38%	10%	206%						98%	113%

\*Dados referentes ao dia 17/05/2024

## ALOCÇÃO



## DISCLAIMER

Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do fundo garantidor de créditos - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. É recomendada a leitura cuidadosa do regulamento, do formulário de informações complementares e da lâmina de informações essenciais pelo investidor ao aplicar seus recursos. Os investidores devem estar preparados para aceitar os riscos inerentes aos diversos mercados em que os fundos atuam e, conseqüentemente, possíveis variações no patrimônio investido.

