

Objetivo do Fundo

Obter retornos significativos acima do CDI no longo prazo, potencialmente descorrelacionados do desempenho do mercado, utilizando estratégias quantitativas executadas de forma sistemática.

Política de Investimentos

Consiste em aplicar no mínimo 95% de suas cotas no ENTERCAPITAL TURING FIM, que busca através de estratégias sistemáticas e quantitativas, gerar retorno acima do CDI, de maneira descorrelacionada, através da construção de um portfólio diversificado.

Os ativos são negociados nos mercados de renda fixa, renda variável, commodities, moedas e derivativos, locais e internacionais, sempre sob uma perspectiva de preservação de capital e pela busca de oportunidades de médio e longo prazos, através da identificação de novas estratégias quantitativas.

Recomenda-se a leitura atenta do regulamento do fundo.

Informações Gerais

Administrador
BEM DTVM

Gestor
EnterCapital Gestão de Recursos Ltda

Custódia
BEM DTVM

Público Alvo
Investidores em geral

Auditor
Pricewaterhousecoopers

Taxa de Administração
2.000%

Aplicação Inicial
R\$ 100.00

Movimentação Mínima
R\$ 100.00

Saldo Mínimo de Permanência
R\$ 100.00

Horário de Movimentação
12:30

Início do Fundo
22/out/19

Início da Atual Gestão
22/out/19

Categoria Anbima
Multimercado Livre

Cota
Fechamento

Tributação
Longo Prazo

Taxa de Performance
20%

Aplicação - Cotização
D+1 dia útil após a data de aplicação

Solicitação de Resgate
A qualquer momento (sem carência)

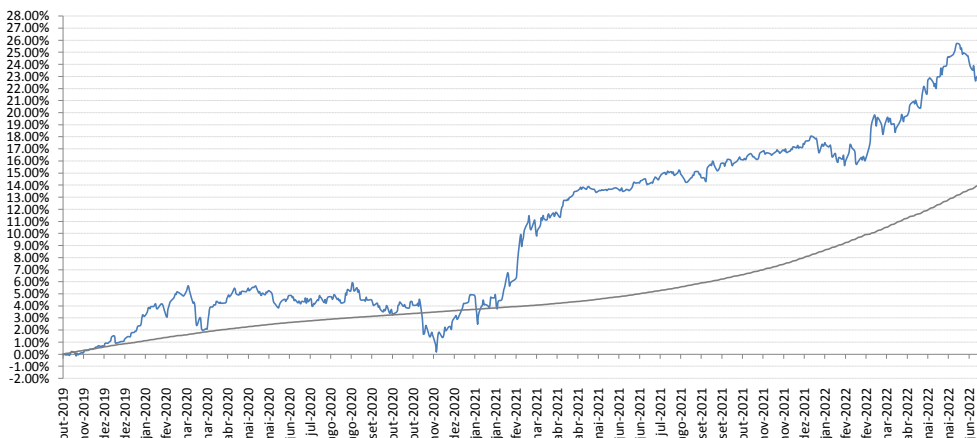
Resgate - Cotização
D+15 dias corridos

Resgate - Pagamento
D+1 dia útil após a data de cotização

Volatilidade Objetiva

6% - 8% a.a.

Gráfico de Rentabilidade - ENTERCAPITAL TURING FIC FIM



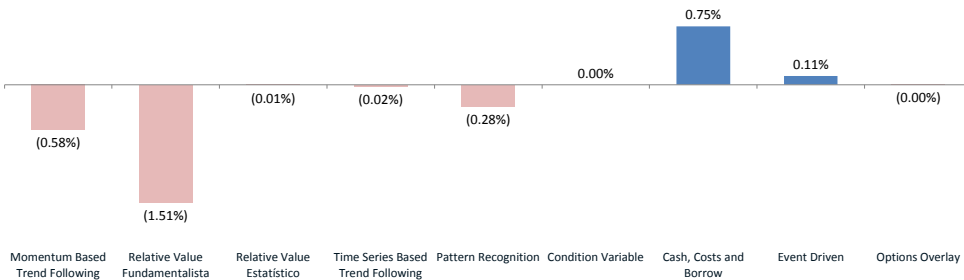
Estatísticas

PL atual Fundo Master	R\$ 133,060,865
PL do Fundo em 30/jun/2022	R\$ 120,806,750
PL médio desde o início	R\$ 83,972,719
Retorno Acumulado	23.04%
CDI Acumulado	14.15%
Retorno Médio Mensal	0.64%
Volatilidade anualizada	4.80%
Sharpe	0.69
Número de meses negativos	9
Número de meses positivos	24
Número de meses abaixo do CDI	13
Número de meses acima do CDI	20
Maior rentabilidade mensal	5.67%
Menor rentabilidade mensal	-2.56%

Correlação de 12 meses

Ibovespa	0.12
Dólar	-0.28
IMA-B	0.00
Pré - 1Y	-0.13
Índice de Hedge Funds (IHFA)	0.17

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2022														
Fundo	(1.59%)	(0.11%)	2.40%	2.82%	2.29%	(1.54%)	-	-	-	-	-	-	4.23%	23.03%
CDI	0.73%	0.76%	0.93%	0.83%	1.03%	1.02%	-	-	-	-	-	-	5.42%	14.16%
CDI+	(2.33%)	(0.86%)	1.47%	1.99%	1.26%	(2.56%)	-	-	-	-	-	-	(1.19%)	8.87%
2021														
Fundo	(0.53%)	5.67%	1.22%	1.96%	(0.12%)	0.60%	0.60%	0.02%	0.76%	0.37%	0.46%	0.98%	12.50%	18.03%
CDI	0.15%	0.13%	0.20%	0.21%	0.27%	0.31%	0.36%	0.43%	0.44%	0.49%	0.59%	0.77%	4.42%	8.29%
CDI+	(0.68%)	5.53%	1.02%	1.75%	(0.39%)	0.29%	0.25%	(0.41%)	0.31%	(0.12%)	(0.13%)	0.21%	8.08%	9.75%
2020														
Fundo	2.27%	1.02%	(0.72%)	1.08%	0.05%	(0.81%)	0.30%	0.75%	(1.81%)	0.45%	(2.56%)	3.47%	3.41%	4.92%
CDI	0.38%	0.29%	0.34%	0.28%	0.24%	0.22%	0.19%	0.16%	0.16%	0.16%	0.15%	0.16%	2.77%	3.71%
CDI+	1.90%	0.73%	(1.06%)	0.80%	(0.19%)	(1.03%)	0.11%	0.59%	(1.97%)	0.29%	(2.70%)	3.30%	0.64%	1.21%
2019														
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.21%	0.50%	0.75%	1.46%	1.46%
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.15%	0.38%	0.38%	0.91%	0.91%
CDI+	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.06%	0.11%	0.37%	0.55%	0.55%



Contribuição Classe de Estratégia em JUN/2022

Momentum Based Trend Following	(0.58%)
Relative Value Fundamentalista	(1.51%)
Relative Value Estatístico	(0.01%)
Time Series Based Trend Following	(0.02%)
Pattern Recognition	(0.28%)
Condition Variable	0.00%
Cash, Costs and Borrow	0.75%
Event Driven	0.11%
Options Overlay	(0.00%)
Total	(1.54%)

CONTATO COMERCIAL

Artur Ignarra | EnterCapital Gestão de Recursos | www.entercapital.com.br
+55 (11) 2372-1391 | Rua George Ohm, 206, 74A | São Paulo - SP | CEP 04576-020
artur@entercapital.com.br | Tel: +55 11 2372-1391 | contato@entercapital.com.br



As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Regulamento do fundo, disponível em www.entercapital.com.br/fundos. As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada. A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de resgate antecipado. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo fundo garantidor de crédito (FGC). Leia a lâmina de informações essenciais e o regulamento do fundo antes de investir.