Tagus Absoluto FIM

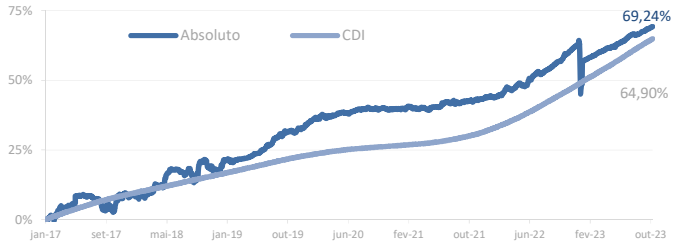
Outubro 2023

Público alvo: Pessoas Físicas e Jurídicas em geral.

Objetivo: O Tagus Absoluto FIM é um fundo multimercado multiestratégia cujo objetivo é obter ganhos de capital de forma consistente no longo prazo.

Política de Investimento Resumida: A administração dinâmica do portfólio, através da combinação de estratégias diferenciadas, busca capturar as oportunidades do mercado mantendo um equilíbrio saudável entre o risco e o retorno esperado. Opera nos Mercados de bolsa, câmbio e juros.

Desempenho Histórico

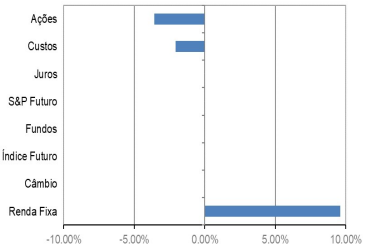


Análise e Performance de Risco

Retorno s/CDI desde Jan/2017	106,69%
Número de Meses Positivos	64
Número de Meses Negativos	18
Retorno Acumulado 12 meses	7,21%
Maior Retorno Mensal	4,58%
Menor Retorno Mensal	-3,34%
Vol (anualizada)*	9,89%
Índice de Sharpe**	(0,63)
VaR (Diário com 95% de confiança)*	1,02%

*, ** Base - Ultimos 12 meses

Atribuição de Performance (Anual)



Rentabilidades

	jan/23	fev/23	mar/23	abr/23	mai/23	jun/23	jul/23	ago/23	set/23	out/23	nov/23	dez/23	2023	Acum.
Absoluto	-3,34%	0,84%	0,97%	0,76%	0,27%	1,29%	1,21%	0,29%	0,84%	0,82%	-----	-----	3,94%	69,24%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	-----	-----	11,02%	64,90%
% CDI	-297,48%	91,37%	82,31%	82,79%	24,29%	120,62%	113,34%	25,89%	85,86%	82,41%	-----	-----	35,77%	106,69%

	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	2022	Acum.
Absoluto	0,25%	0,83%	0,80%	1,22%	-0,13%	2,15%	0,46%	1,17%	1,47%	1,12%	1,74%	1,38%	13,16%	62,82%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,37%	48,52%
% CDI	33,69%	111,13%	87,06%	146,02%	-12,74%	211,77%	44,09%	100,41%	136,70%	109,73%	170,08%	122,71%	106,32%	129,45%

	jan/21	fev/21	mar/21	abr/21	mai/21	jun/21	jul/21	ago/21	set/21	out/21	nov/21	dez/21	2021	Acum.
Absoluto	0,23%	-0,18%	0,26%	-0,56%	0,79%	0,85%	0,17%	-0,07%	0,51%	0,01%	0,52%	0,45%	3,01%	43,89%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,40%	32,17%
% CDI	155,87%	-132,12%	130,11%	-267,58%	296,83%	278,00%	46,67%	-17,48%	116,02%	1,82%	88,11%	59,30%	68,46%	136,42%

	jan/20	fev/20	mar/20	abr/20	mai/20	jun/20	jul/20	ago/20	set/20	out/20	nov/20	dez/20	2020	Acum.
Absoluto	0,85%	0,63%	0,25%	0,73%	0,02%	0,52%	0,45%	0,21%	-0,06%	0,18%	-0,29%	0,05%	3,61%	39,68%
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%	26,61%
% CDI	225,92%	212,76%	73,89%	256,81%	9,29%	242,86%	230,98%	128,00%	-35,89%	116,90%	-191,00%	31,93%	130,31%	149,16%

	jan/19	fev/19	mar/19	abr/19	mai/19	jun/19	jul/19	ago/19	set/19	out/19	nov/19	dez/19	2019	Acum.
Absoluto	3,40%	-0,49%	0,44%	0,63%	1,02%	1,16%	1,78%	2,42%	0,71%	-0,22%	1,34%	1,42%	14,41%	34,82%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%	23,20%
% CDI	625,99%	-99,53%	93,87%	121,01%	187,08%	246,97%	313,98%	479,79%	153,26%	-46,18%	352,88%	376,31%	241,43%	150,12%

Informações Gerais

Data de Início: 19 de Janeiro de 2017 - Gestão Tagus
Classificação: Multimercado
Patrimônio Líquido atual: R$ 6.604.859,78
Patrimônio Líquido Médio (12 meses): R$ 15.270.634,76
Número de Cotistas: 121
Aplicação Inicial: R$ 1.000,00
Movimentação e Saldo Minimo: R$ 1.000,00
Taxa de Administração: 2,00% ao ano
Taxa de Performance: 20% sobre o que exceder 100% do CDI
Aplicação: até as 14h, cota de D+0
Resgate: Até as 13h. Cotização: D0 (fechamento).
Pagamento: D+1 útil.
IR: Longo Prazo, tabela regressiva de 22,5% a 15,0%
Categoria ANBIMA: Multimercados Livre
Código ANBIMA: 346241
Custódia: Banco BTG Pactual S/A
Gestor: Tagus Investimentos LTDA
Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM
Auditor: Ernst &Young

Como Investir

Atendimento: de 9h as 18h; tel: +55 21 3202-9600
ou email: atendimento@tagusinvestimentos.com.br

Dados Bancários

Favorecido: Tagus Absoluto FIM
Banco: BTG Pactual (208)
Agência: 001
Conta Corrente: 001011610
CNPJ: 12.120.451/0001-41

Este material tem caráter meramente informativo e não deve ser considerado como uma oferta para compra de cotas do Fundo. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM A GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC. LEIA O PROSPECTO, QUANDO APLICÁVEL, E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os fundos multimercados com renda variável podem estar expostos a significativa concentração de ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Este fundo utiliza estratégias com derivatvos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Administradora: BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM . CNPJ: 59.281.253/0001-23 Praia de Botafogo, 501 Rio de Janeiro - RJ - Brasil Telefone: +55 21 3262 9600 Telefone: 0800 7722 827E-mail: sac@btgpactual.com

ANBIMA
A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.