

Características do Fundo

**Objetivo:** Obter retornos superiores ao CDI, consistentes e descorrelacionados no longo prazo, por meio de carteira diversificada de investimentos ajustada ao mandato de risco definido.

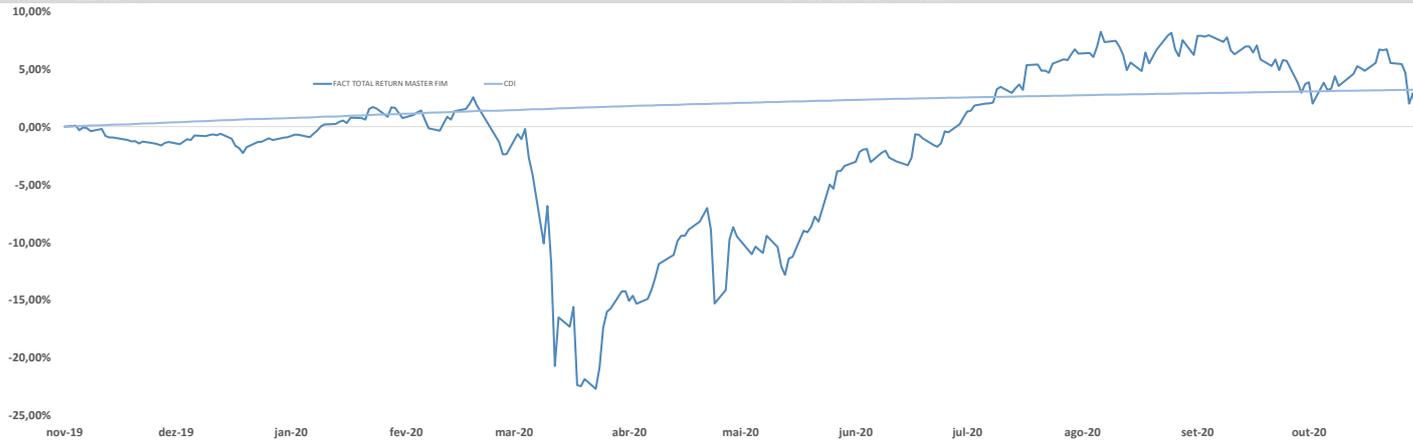
**Público-alvo:** investidores em geral.

Rentabilidade Mensal

	JAN	FEV	MAR	(+) ABR	MAI	JUN	JUL	(+) AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INICIO
<b>2015</b>				<b>0,43%</b>	<b>1,89%</b>	<b>0,85%</b>	<b>2,37%</b>	<b>1,94%</b>	<b>1,94%</b>	<b>3,76%</b>	<b>1,54%</b>	<b>1,74%</b>	<b>15,44%</b>	<b>15,44%</b>
% CDI				57,1%	191,8%	80,2%	201,6%	174,9%	175,1%	168,7%	146,4%	150,1%	155,5%	155,5%
<b>2016</b>	<b>1,31%</b>	<b>0,65%</b>	<b>-1,95%</b>	<b>-0,29%</b>	<b>3,20%</b>	<b>-0,18%</b>	<b>-0,52%</b>	<b>1,21%</b>	<b>1,19%</b>	<b>-1,40%</b>	<b>1,59%</b>	<b>1,80%</b>	<b>6,68%</b>	<b>23,16%</b>
% CDI	123,9%	64,6%	-	-	288,7%	-	-	99,9%	107,8%	-	153,1%	160,5%	47,7%	91,5%
<b>2017</b>	<b>0,26%</b>	<b>-0,40%</b>	<b>1,80%</b>	<b>1,21%</b>	<b>2,77%</b>	<b>1,96%</b>	<b>-0,74%</b>	<b>-0,14%</b>	<b>-0,11%</b>	<b>0,62%</b>	<b>0,14%</b>	<b>-0,34%</b>	<b>7,19%</b>	<b>32,01%</b>
% CDI	23,9%	-	171,6%	152,9%	299,2%	241,9%	-	-	-	95,3%	24,0%	-	72,2%	84,7%
<b>2018</b>	<b>-0,66%</b>	<b>1,11%</b>	<b>-0,01%</b>	<b>-0,16%</b>	<b>-3,53%</b>	<b>0,37%</b>	<b>2,41%</b>	<b>-0,26%</b>	<b>0,84%</b>	<b>4,48%</b>	<b>1,85%</b>	<b>0,12%</b>	<b>6,55%</b>	<b>40,66%</b>
% CDI	-	238,1%	-	-	-	71,5%	444,0%	-	178,4%	824,5%	375,3%	25,1%	102,0%	87,2%
<b>2019</b>	<b>6,28%</b>	<b>1,20%</b>	<b>1,35%</b>	<b>1,42%</b>	<b>1,43%</b>	<b>3,79%</b>	<b>2,51%</b>	<b>0,95%</b>	<b>1,80%</b>	<b>2,80%</b>	<b>-1,14%</b>	<b>0,41%</b>	<b>25,11%</b>	<b>75,99%</b>
% CDI	1156,8%	242,5%	288,1%	273,7%	263,5%	808,3%	441,5%	188,9%	386,3%	582,7%	-	107,7%	420,8%	137,2%
<b>2020</b>	<b>1,68%</b>	<b>-3,10%</b>	<b>-12,17%</b>	<b>5,56%</b>	<b>6,74%</b>	<b>4,32%</b>	<b>5,50%</b>	<b>-0,10%</b>	<b>-2,37%</b>	<b>-2,38%</b>			<b>2,16%</b>	<b>79,79%</b>
% CDI	446,1%	-	-	1950,7%	2822,5%	2008,3%	2828,7%	-	-	-			88,5%	134,8%

Retorno - 12 Meses

Volatilidade - Início



Informações do Fundo

Rentabilidade Acumulada	12 Months	Inception
Retorno	1,64%	79,79%
CDI	3,22%	59,20%
% CDI	50,9%	134,8%
Volatilidade Anualizada	23,41%	11,27%
Sharpe	-	0,30
% Meses acima CDI	50%	55%
Melhor Mês   Pior Mês	6,7% / -12%	6,7% / -12%

Atribuição de Performance



Características Operacionais

PL (R\$):	85.573.866
PL Médio - 12 Meses (R\$):	112.498.399
Taxa de Administração:	0,0% aa
Taxa de Performance:	Não há
Aplicação/Resgate	Até as 13:00
Cotização de Aplicações:	D+0
Cotização de Resgates:	D+0
Pagamento de Resgates:	D+1
Aplicação Inicial Mínima:	20.000
Movimentação Mínima:	5.000
Saldo Mínimo por Cotista:	20.000
Classificação ANBIMA:	Multimercado Estratégia Macro
Admite Alavancagem	Sim
Nome do Fundo:	FACT TOTAL RETURN MASTER FIM
CNPJ:	21.805.389/0001-12
Gestor:	Fact Investments Gestão de Recursos Ltda.
Administrador:	INTRAG DTVM LTDA.
Custodiante:	Itau Unibanco S.A.
Contato:	11-3073-0741
Site:	<a href="http://www.factinvest.com.br">www.factinvest.com.br</a>
Início do Fundo:	07/abr/15

DISCLAIMER

A FACT INVESTMENTS GESTÃO DE RECURSOS LTDA. ("FACT") NÃO COMERCIALIZA NEM DISTRIBUI COISAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO OU DE QUALQUER OUTRO ATIVO FINANCEIRO. AS INFORMAÇÕES AQUI CONTIDAS SÃO DE CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO E NÃO SE CONSTITUEM EM QUALQUER TIPO DE ACONSELHAMENTO, SUGESTÃO OU OFERTA DE INVESTIMENTOS, NÃO DEVENDO SER UTILIZADAS COM ESTE PROPÓSITO. Os investidores devem se basear nas informações aqui contidas ao buscar o aconselhamento de um profissional. Nenhuma informação aqui contida é divulgada com o intuito de recomendar ou sugerir a venda de cotas de qualquer fundo de investimento gerido pela FACT, ou de qualquer outro valor mobiliário, nem poderá ser entendida como tal em qualquer jurisdição, na qual tal solicitação, oferta ou recomendação seriam consideradas ilegais. OS INVESTIMENTOS EM FUNDOS NÃO CONTAM COM A GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEBRO OU AMPLIA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. Sobre os ganhos auferidos, incluídos tributos, assim, a previsão ou estimativa de rentabilidade não é líquida de impostos, sendo base de cálculo para a incidência de tributos, que podem ter significativo impacto na rentabilidade final da operação pretendida. As rentabilidades divulgadas não são líquidas de imposto de renda. Nos termos da regulamentação da ANBIMA, para avaliação de desempenho dos fundos de investimento, é recomendada uma análise de períodos de, no mínimo, 12 (doze) meses. ALGUNS FUNDOS TEM MÊSES DE 12 (DOZE) MESES. PARA ANÁLISE DA PERFORMANCE DE UM FUNDO DE INVESTIMENTO, É RECOMENDADA A ANÁLISE DE, NO MÍNIMO, 12 (DOZE) MESES. A RENTABILIDADE DEBITA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. Investimentos nos fundos de investimento geridos ou estruturados pela FACT, assim como em quaisquer investimentos no mercado financeiro e de capitais, estão sujeitos a riscos de perda do capital investido. Os investidores devem considerar sempre que o valor de seus investimentos pode aumentar ou diminuir. Além disso, em caso de eliminação do valor a pagar, os investidores podem não recuperar o valor inicial investido. Este fundo de investimento não é considerado como parte integrante de sua política de investimento, tais estratégias, de forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado, sob a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir eventual patrimônio negativo dos fundos.

A LISTA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS ENCONTRA-SE DISPONÍVEL NO SITE DO ADMINISTRADOR E NO SITE DA CVM. LEIA O PROSPECTO E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR, submetido nos termos referidos à Política de Investimentos. Fatores de Risco e regras para resgate de cotas. A autorização para funcionamento e/ou venda, pelos membros do sistema de distribuição, de cotas de fundos de investimento e os demais valores mobiliários não implica, por parte da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) ou da ANBIMA, em garantia de veracidade das informações prestadas, de adequação dos respectivos regulamentos e prospectos à legislação vigente ou, ainda, julgamento sobre a qualidade dos fundos e demais valores mobiliários, de seu administrador, gestor e demais prestadores de serviços. A CVM e a ANBIMA não respondem pelo desempenho ou a rentabilidade dos fundos de investimento. A FACT não distribui cotas de fundos de investimento, para realização de investimento em fundo, é necessário prévio cadastro junto ao administrador do fundo. A FACT, seus administradores, funcionários e prepostos não se responsabilizam sobre quaisquer danos resultantes de qualquer uso indevido da utilização das informações contidas neste relatório, ou que a tomada de decisão de investimento é do cotista. O conteúdo deste material não deverá ser reproduzido, distribuído, publicado ou divulgado sob qualquer pretexto. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Os fundos multimercado com renda variável podem estar sujeitos a classificação orientadora em função de natureza essencialmente, em vez de natureza de longo prazo.

