

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.

Rentabilidade Mensal

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INICIO
<b>2019</b>								<b>0,04%</b>	<b>1,32%</b>	<b>2,14%</b>	<b>-1,07%</b>	<b>0,23%</b>	<b>2,65%</b>	<b>2,65%</b>
% CDI								8,6%	283,4%	443,9%	-	60,5%	119,0%	119,0%
<b>2020</b>	<b>1,31%</b>	<b>-3,04%</b>	<b>-12,81%</b>	<b>5,31%</b>	<b>6,32%</b>	<b>3,99%</b>	<b>4,65%</b>	<b>-0,22%</b>	<b>-2,20%</b>	<b>-2,50%</b>	<b>5,34%</b>	<b>6,61%</b>	<b>11,48%</b>	<b>14,44%</b>
% CDI	347,0%	-	-	1862,5%	2647,3%	1852,9%	2392,2%	-	-	-	3573,6%	4017,0%	415,0%	285,6%
<b>2021</b>	<b>-4,81%</b>	<b>0,05%</b>	<b>1,93%</b>	<b>2,52%</b>	<b>1,30%</b>	<b>-0,44%</b>	<b>-2,52%</b>	<b>-1,18%</b>	<b>-0,34%</b>	<b>-7,43%</b>	<b>-0,01%</b>	<b>2,77%</b>	<b>-8,34%</b>	<b>4,89%</b>
% CDI	-	34,9%	972,1%	1213,2%	485,9%	-	-	-	-	-	-	362,5%	-	50,5%

Retorno - 12 Meses

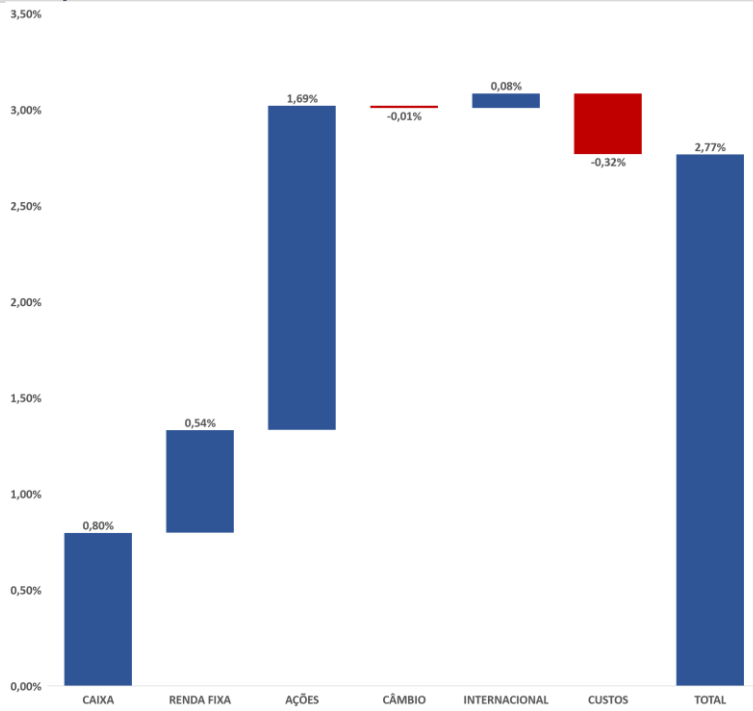


Informações do Fundo

Rentabilidade Acumulada	12 Months	Inception
Retorno	-8,34%	4,89%
CDI	4,40%	9,68%
% CDI	-	50,5%
Volatilidade Anualizada *	10,4%	16,8%
Sharpe	-	-
% Meses acima CDI	33%	45%
Melhor Mês   Pior Mês	6,6%   -7,4%	6,6%   -12,8%

\* Volatilidade anualizada para período de 6 meses

Atribuição de Performance



Características Operacionais

PL (R\$):	6.154.655
PL Médio-12 Meses (R\$):	5.970.629
PL Total da Estratégia (R\$):	296.580.513
Taxa de Administração:	2,0% aa
Taxa de Performance:	20% sobre o retorno que exceder o CDI
Aplicação/Resgate:	Até as 13:00
Cotização de Aplicações:	D+1
Cotização de Resgates:	D+30
Pagamento de Resgates:	D+31
Aplicação Inicial Mínima:	1.000
Movimentação Mínima:	1.000
Saldo Mínimo por Cotista:	1.000
Classificação ANBIMA:	Multimercado Estratégia Macro
Nome do Fundo:	FACT TOTAL RETURN FIC FIM
CNPJ:	32.320.740/0001-00
Gestor:	Fact Investments Gestão de Recursos Ltda.
Distribuidores:	Ativa Investimentos, BTG Pactual Digital
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:	31/jul/19

DISCLAIMER

A FACT INVESTMENTS GESTÃO DE RECURSOS LTDA. ("FACT") não comercializa nem distribui cotas 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 COMO ESTE PROPÓSITO. Os investidores devem se basear nas informações aqui contidas sem basear o aconselhamento de um profissional. Nenhuma informação aqui contida é divulgada com o intuito de ser considerada uma recomendação de investimento, nem poderá ser entendida como tal em qualquer jurisdição a qual tal solicitação, oferta ou recomendação seriam consideradas legais. OS INVESTIMENTOS EM FUNDOS NÃO CONTAM COM A GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FIDELIDADE DO FUNDO GARANTIDOR DE CREDITOS - FGC. Sobre os ganhos auferidos incide tributação, assim, a previsão ou estimativa de rentabilidade é líquida de impostos, sendo base de cálculo para a incidência de tributos, que podem ter significativo impacto na rentabilidade final da operação planejada. As rentabilidades divulgadas não são líquidas de imposto de renda. Nos termos da regulamentação da ANBIMA, para avaliação da performance dos fundos de investimento, é recomendada uma análise de períodos de, no mínimo, 12 (doze) meses. AVALIAÇÃO DA PERFORMANCE DE UM FUNDO DE INVESTIMENTO, RECOMENDAVEL, A ANÁLISE DE, NO MÁXIMO, 12 (DOZE) MESES. A RENTABILIDADE CERTA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. Investimentos nos fundos de investimento geridos ou estruturados pela FACT, assim como em qualquer investimento 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 distribuição do valor e perdas, os investidores podem não recuperar o valor inicial investido. Este fundo de investimento possui estratégias de gestão de risco, porém, não há garantia de que os investidores não sofrerão perdas superiores ao capital aplicado e, conseqüente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir eventual patamar negativo dos fundos. A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS ENCONTRA-SE DISPONÍVEL NO SITE DO ADMINISTRADOR E NO SITE DA CVM. LEIA O PROSPECTO E REGULA MENTO ANTES DE INVESTIR, sobretudo nos seus resumos e Política de Investimento. Fatores de risco e regras para resgate de cotas. A autorização para funcionamento é via venda, pelos membros do sistema de distribuição, de cotas de fundos de investimento e demais valores mobiliários não implica, por parte da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) ou da ANBIMA, em garantia de veracidade das informações prestadas, de observância 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 responderão pelo desempenho e rentabilidade dos fundos de investimento. A FACT não distribui cotas de fundos de investimento, para realização de investimento em fundos é necessário prévio cadastro junto ao administrador do fundo. A FACT, seus administradores, funcionários e prepostos isentam-se de responsabilidade sobre quaisquer dados, resultados diretos ou indiretos da utilização das informações contidas neste relatório, já 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. A taxa de administração prevista acima é a taxa de administração mínima do fundo. 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 significativa concentração em ativos de poucas emissoras, com o risco de desconexões.

Contatos Administrador: Intrag Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ 02.418.149/0001-33) com sede na Cidade e Estado de São Paulo, na Av. Brigadeiro Faria Lima, no 3400-50 andar, Bairro Itaim Bibi, CEP: 04538-132 Telefone: (11) 2740-2053 <http://www.intrag.com.br/>.

