

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

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	INÍCIO
2015				0,43%	1,89%	0,85%	2,37%	1,94%	1,94%	1,78%	1,54%	1,74%	15,44%	15,44%
% CDI				57,1%	191,8%	80,2%	201,6%	174,9%	175,1%	161,1%	146,4%	150,1%	155,5%	155,5%
2016	1,31%	0,65%	-1,95%	-0,29%	3,20%	-0,18%	-0,52%	1,21%	1,19%	-1,40%	1,59%	1,80%	6,68%	23,16%
% CDI	123,9%	64,6%	-	-	288,7%	-	-	99,9%	107,8%	-	153,1%	160,5%	47,7%	91,5%
2017	0,26%	-0,40%	1,80%	1,21%	2,77%	1,96%	-0,74%	-0,14%	-0,11%	0,62%	0,14%	-0,34%	7,19%	32,01%
% CDI	23,9%	-	171,6%	152,9%	299,2%	241,9%	-	-	-	95,3%	24,0%	-	72,2%	84,7%
2018	-0,66%	1,11%	-0,01%	-0,16%	-3,53%	0,37%	2,41%	-0,26%	0,84%	4,48%	1,85%	0,12%	6,55%	40,66%
% CDI	-	238,1%	-	-	-	71,5%	444,0%	-	178,4%	824,5%	375,3%	25,1%	102,0%	87,2%
2019	6,28%	1,20%	1,35%	1,42%	1,43%	3,79%	2,51%	0,95%	1,80%	2,80%	-1,14%	0,41%	25,11%	75,99%
% 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%
2020	1,68%	-3,10%	-12,17%	5,56%	6,74%	4,32%	5,50%	-0,10%	-2,37%	-2,38%	6,03%	8,38%	17,40%	106,61%
% CDI	446,1%	-	-	1950,7%	2822,5%	2008,3%	2828,7%	-	-	-	4032,2%	5096,2%	628,7%	178,6%
2021	-4,64%	0,21%	2,13%	2,79%	1,53%	-0,28%	-2,33%	-1,00%	-0,16%	-7,30%	0,20%	3,00%	-6,19%	93,82%
% CDI	-	156,6%	1077,1%	1341,7%	571,7%	-	-	-	-	-	34,0%	393,3%	-	140,6%

Retorno - 12 Meses



Informações do Fundo

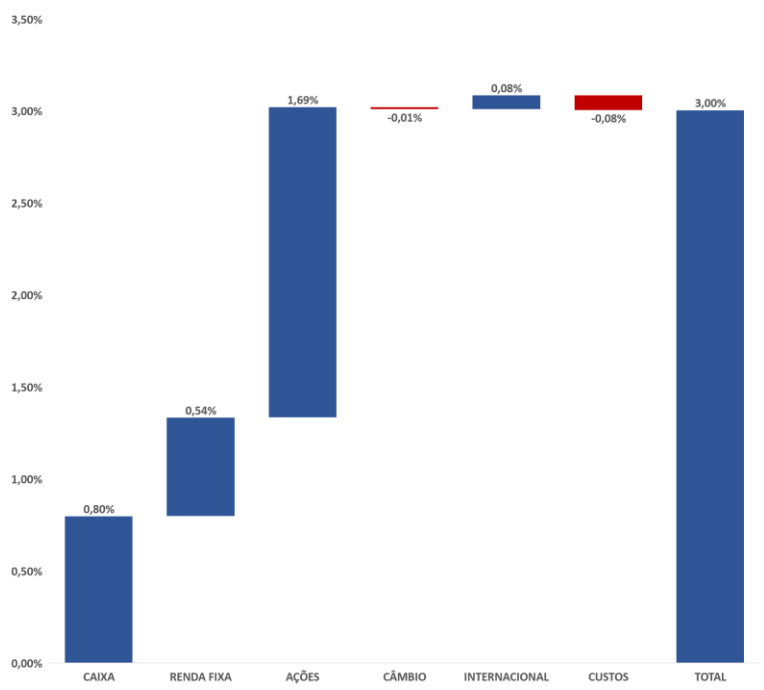
Rentabilidade Acumulada	12 Months	Inception
Retorno	-6,19%	93,82%
CDI	4,40%	66,73%
% CDI	-	140,6%
Volatilidade Anualizada *	10,4%	11,1%
Sharpe	-	0,32
% Meses acima CDI	42%	54%
Melhor Mês / Pior Mês	3,0% / -7,3%	8,4% / -12,2%

* Volatilidade anualizada para período de 6 meses

Características Operacionais

PL (R\$):	296.580.513
PL Médio - 12 Meses (R\$):	128.694.371
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
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:	www.factinvest.com.br
Início do Fundo:	07/abr/15

Atribuição de Performance



DISCLAIMER

A FACT INVESTMENTS GESTÃO DE RECURSOS LTDA. ("FACT") não disponibiliza 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 QUAL QUER TIPO DE ACONSELHAMENTO, SUGESTÃO OU OFERTA DE INVESTIMENTOS, NÃO DEVENDO SER UTILIZADAS COM ESTE PROPÓSITO. Os investidores não devem se basear nas informações aqui contidas sem basear o aconselhamento de um profissional. Nenhuma informação aqui contida é divulgada com o intuito de recomendar ou desencorajar qualquer compra ou venda de cotas de qualquer fundo de investimento gerido pela FACT, ou de quaisquer outros valores mobiliários, nem possui qualquer intenção de induzir ou persuadir a qualquer decisão de investimento, nem recomendação ou sugestão de investimento. Os investidores devem considerar sempre que o valor de seus investimentos pode aumentar ou diminuir. Além disso, em caso de diminuição do valor e perdas, os investidores podem não recuperar o valor inicial investido. Este fundo de investimento utiliza estratégias com derivativos 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 e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir eventuais prejuízos dos fundos.

A LISTA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS ENCONTRA-SE DISPONÍVEL NO SITE DO ADMINISTRADOR E NO SITE DA CVM. O PROPOSTO E O REGULAMENTO DE INVESTIR, elaborado nos termos referidos à Política de Investimento, Fatores de Risco e regras para resgate de cotas, a atribuição de performance e de vendas, após o momento do sistema de distribuição, de cotas de fundos de investimento e demais valores mobiliários não emitidos, 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 sua administração, gestor e demais prestatadores de serviços. A CVM e a ANBIMA não respondem pelo desempenho 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 prestatadores de serviços não se responsabilizam por quaisquer danos ou prejuízos decorrentes 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 efetiva do fundo. Esta informação está atualizada e referente a investimentos em valores mobiliários 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 pouco emissivos, com o risco de não decorrentes.

