

Características do Fundo

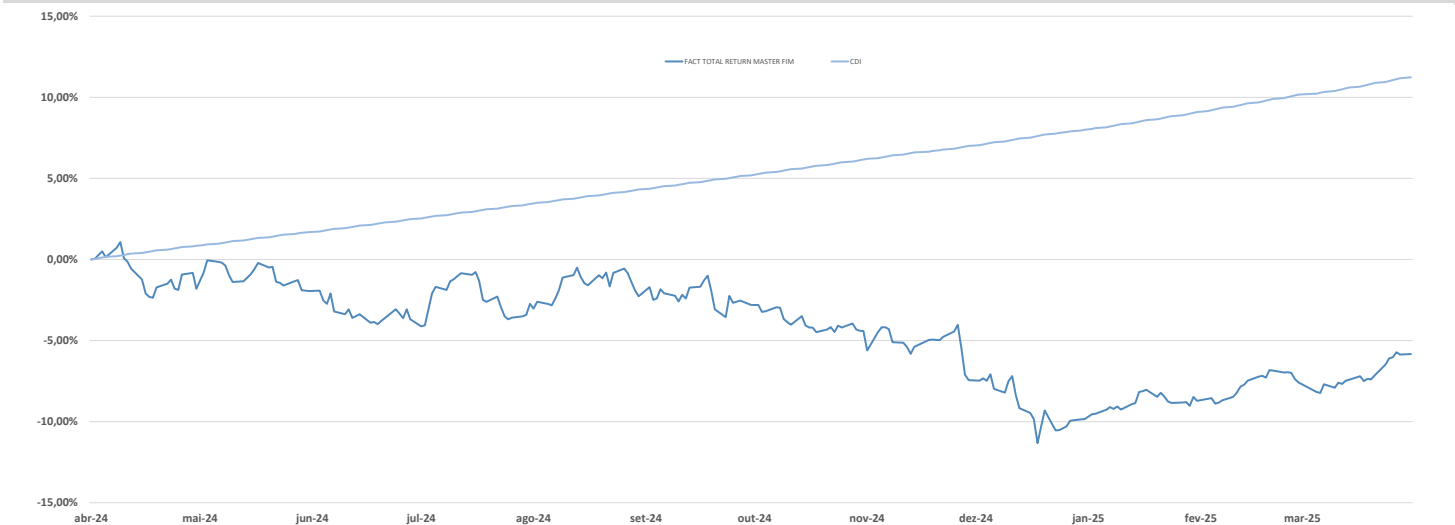
Objetivo: Obter retornos superiores ao CDI, consistentes e descorrelacionados no longo prazo, por meio de carteira diversificada de investimentos ajustada ao mandato de risco definido.

Público-alvo: investidores em geral.

Rentabilidade Mensal

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	INICIO
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%	-	185,9%	-
2022	2,35%	0,44%	3,64%	0,54%	1,85%	-2,11%	0,09%	2,55%	1,24%	2,34%	1,37%	0,41%	15,60%	124,06%
% CDI	320,4%	58,8%	393,9%	65,2%	179,9%	-	8,7%	218,4%	115,8%	228,9%	133,9%	36,9%	126,1%	142,0%
2023	1,33%	-2,01%	-1,88%	0,13%	0,73%	0,28%	1,86%	0,11%	1,33%	2,52%	0,86%	0,86%	5,50%	136,37%
% CDI	118,4%	-	-	14,0%	65,4%	26,3%	173,7%	9,4%	136,5%	19,2%	275,1%	96,3%	42,1%	122,00%
2024	-0,31%	1,14%	1,18%	-2,08%	-0,14%	-1,78%	0,99%	0,49%	-0,55%	-1,62%	-3,17%	-2,60%	-8,28%	116,80%
% CDI	-	142,5%	141,5%	-	-	-	108,6%	56,0%	-	-	-	-	-	86,63%
2025	1,25%	1,24%	1,90%										4,45%	126,45%
% CDI	123,8%	125,9%	197,8%										148,8%	89,15%

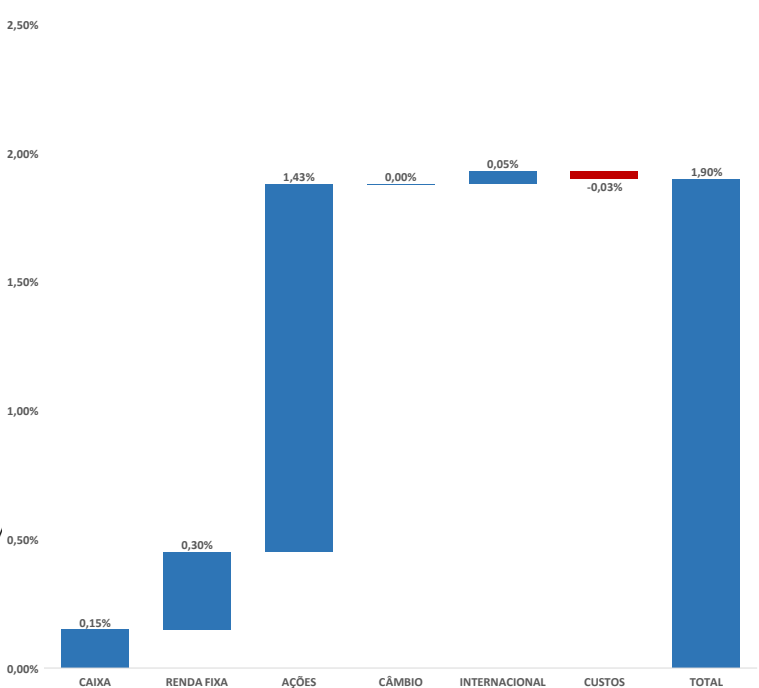
Retorno - 12 Meses



Informações do Fundo

Rentabilidade Acumulada	12 Months	Inception
Retorno	-6,09%	126,45%
CDI	11,26%	141,85%
% CDI	-	89,1%
Volatilidade Anualizada	7,9%	9,8%
Sharpe	-	-
% Meses acima CDI	33%	51%
Melhor Mês Pior Mês	1,90% / -3,17%	8,4% / -12,2%

Atribuição de Performance



Características Operacionais

PL (R\$):	483.563.581
PL Médio - 12 Meses (R\$):	566.346.926
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+1
Pagamento de Resgates:	D+3
Aplicação Inicial Mínima:	20.000
Movimentação Mínima:	5.000
Saldo Mínimo por Cotista:	20.000
Classificação ANBIMA:	Fundo de Investimento em Ações
Nome do Fundo:	FACT TOTAL RETURN MASTER FIF EM AÇÕES RESP LIM
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

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 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 buscar o aconselhamento de um profissional. Nenhuma informação aqui contida é divulgada com o intuito de constituir uma recomendação para compra ou venda de cotas de qualquer fundo de investimento gerido pela FACT, ou de quaisquer outros valores mobiliários, nem poderá ser entendida como tal em qualquer jurisdição na qual for solicitada, ou seja, recomendações seriam consideradas ilegais. OS INVESTIMENTOS EM FUNDOS NÃO CONTAM COM A GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURANÇA OU ARANJO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. Sobre os ganhos auferidos existe tributação, 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 impostos 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. ALGUNS FUNDOS TEM MÍNIMO DE 12 (DOZE) MESES PARA AVALIAÇÃO DA PERFORMANCE DE UM FUNDO DE INVESTIMENTO. É RECOMENDADA A ANÁLISE DE, NO MÍNIMO, 12 (DOZE) MESES A RENTABILIDADE CRISTA 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. Investimentos 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, da forma como são utilizadas, 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 negativos dos fundos.

A LAMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS ENCONTRA-SE DISPONÍVEL NO SITE DO ADMINISTRADOR E NO SITE DA CVM. LEIA O PROSPECTO E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR, subscrito nos termos referenciados à Política de Investimento, Fatores de Risco e regras para resgate decorrentes. A autorização para funcionamento e/ou venda, pelos membros do sistema de distribuição, de cotas dos 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 sua administração, gestor e demais prestadores de serviços à CVM e a ANBIMA não respondem pelo desempenho e rentabilidade dos fundos de investimento. A FACT não distribui cotas de fundos de investimento, para avaliação de qualquer ativo financeiro ou instrumento de investimento, a responsabilidade sobre quaisquer danos resultantes direta ou indiretamente 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 multimercados com renda variável podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.

