

CARACTERÍSTICAS PRINCIPAIS

OBJETIVO DO FUNDO

Proporcionar aos condôminos valorização de suas cotas, a médio e longo prazo, através da aplicação entre 95% (noventa e cinco por cento) a até 100% (cem por cento) de seu patrimônio líquido em cotas do FATOR MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO, inscrito no CNPJ/MF sob nº 20.584.607/0001-73.

PÚBLICO ALVO

Destina-se a investidores pessoas físicas e jurídicas que estejam dispostos a assumir os riscos dos mercados de renda fixa, moedas, renda variável e crédito privado para buscar rendimentos superiores ao CDI no médio e longo prazo.

INÍCIO DO FUNDO

06/08/2004

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA

Multimercado - Estratégia Macro

CÓDIGO ANBIMA

152536

CÓDIGO BLOOMBERG

FATSIGM:BZ

ISIN

BRFPBICTF006

ADMINISTRADOR

Banco Fator S.A.

GESTOR

Fator Administração de Recursos Ltda.

CUSTODIANTE

Itaú Unibanco S/A

AUDITOR

BDO Auditores Independentes

MOVIMENTAÇÕES

Inicial: R\$ 1.000,00
Movimentação Mínima: R\$1.000,00
Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00

APLICAÇÃO/RESGATES

Aplicação: Cotização D+0

Resgate: Cotização D+0 úteis

Resgate: Liquidação D+0 úteis

DADOS PARA APLICAÇÃO

Banco Itaú Unibanco S/A - 341
Agência: 2001 / Conta: 47.905-0
Favorecido: Fator Sigma FICFI
CNPJ: 06.097.344/0001-47

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

Taxa mínima: 1,0% ao ano, paga mensalmente.
Taxa máxima: 2,3% ao ano, paga mensalmente.
(compreende a taxa de administração mínima e o percentual máximo que a política do fundo admite despendido em razão das taxas de administração dos fundos de investimento investidos).

BENCHMARK

Certificado de Depósitos Interbancário (CDI)

TAXA DE PERFORMANCE

20% sobre o ganho que exceder o CDI

TAXA DE SAÍDA

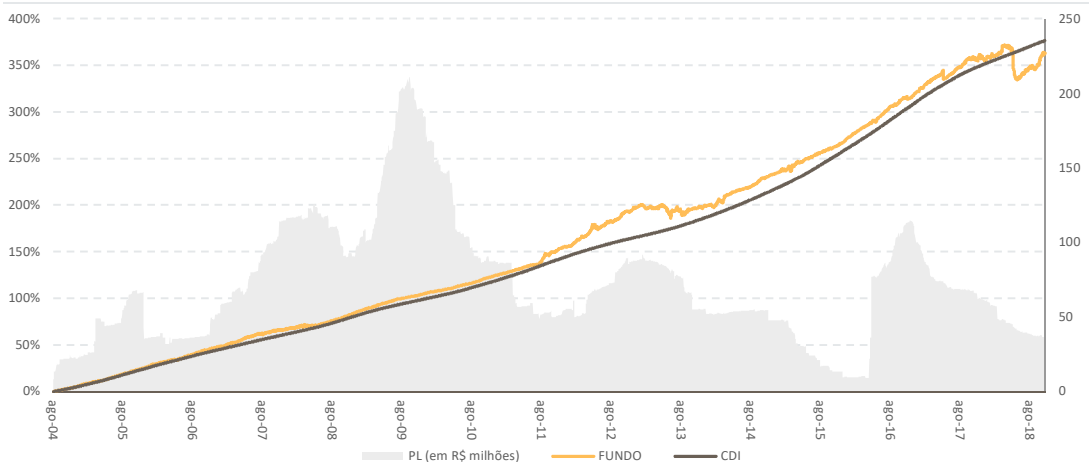
Não se aplica

TRIBUTAÇÃO

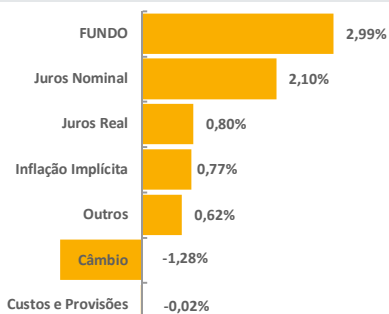
IR: Esse imposto incidirá no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano ("come cotas"), ou no resgate se ocorrido em data anterior, observando-se, adicionalmente o seguinte: enquanto o FUNDO mantiver uma carteira de longo prazo, como tal entendendo-se uma carteira de títulos com prazo médio superior a 365 dias, o imposto de renda será cobrado às alíquotas de: 22,5% prazo de até 180 dias; 20% prazo de 181 até 360 dias; 17,5% em aplicações com prazo de 361 até 720 dias; 15% em aplicações com prazo acima de 720 dias.

IOf: As aplicações com prazo inferiores a 30 dias são sujeitas à cobrança do imposto sobre Operações Financeiras (IOf).

RETORNO (%) FUNDO VS CDI



ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE (%)



VOLATILIDADE (%) Fundo - Anualizada



HISTÓRICO DE DESEMPENHO

	Último Mês	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Desde o início
Fundo	2,99%	1,63%	1,38%	11,63%	27,62%	363,78%
Benchmark	0,54%	5,38%	6,52%	18,32%	34,96%	376,79%
(%) Bench	550,41%	30,26%	21,11%	63,45%	79,00%	96,55%

ESTATÍSTICAS

	Desde o Início	12 Meses	24 Meses
Meses positivos	158	8	18
Meses negativos	13	4	6
Maior ret. Mensal	3,63%	2,99%	2,99%
Menor ret. Mensal	-7,39%	-7,39%	-7,39%
Volatilidade (12 Meses)	3,27%	5,06%	4,13%
PL Atual	R\$ 35.902.549,24		
PL Médio (12 Meses)	R\$ 47.520.230,90		

RETORNO (%)

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2018													
Fundo	1,06%	0,18%	2,16%	-0,26%	-7,39%	0,73%	1,15%	1,07%	0,31%	2,99%			1,63%
% CDI	181,91%	38,46%	405,64%	-	-	140,95%	212,24%	187,92%	66,82%	550,41%			30,26%
2017													
Fundo	0,87%	1,46%	1,09%	0,77%	-0,67%	1,03%	1,36%	1,04%	1,39%	-0,11%	-0,09%	-0,26%	8,15%
% CDI	80,12%	168,57%	103,32%	98,16%	-	126,33%	170,14%	130,12%	217,68%	-	-	-	81,88%
2016													
Fundo	1,19%	1,01%	1,15%	1,06%	0,36%	1,97%	1,31%	1,10%	0,99%	1,06%	0,07%	1,42%	13,45%
% CDI	112,64%	100,79%	99,17%	100,70%	32,92%	169,57%	118,24%	90,54%	89,83%	101,55%	6,52%	126,23%	96,04%
2015													
Fundo	0,58%	1,49%	0,25%	0,96%	1,17%	0,41%	1,31%	0,55%	0,74%	0,64%	0,84%	1,51%	10,94%
% CDI	62,21%	182,22%	24,33%	101,48%	118,42%	38,65%	111,42%	49,74%	66,47%	57,90%	79,60%	129,67%	78,17%