

ENTERCAPITAL TURING FIC FIM

SETEMBRO 2020



Objetivo do Fundo

Obter retornos significativos acima do CDI no longo prazo, potencialmente descorrelacionados do desempenho do mercado, utilizando estratégias quantitativas executadas de forma sistemática.

Política de Investimentos

Consiste em aplicar no mínimo 95% de suas cotas no ENTERCAPITAL TURING FIM, que busca através de estratégias sistemáticas e quantitativas, gerar retorno acima do CDI, de maneira descorrelacionada, através da construção de um portfólio diversificado.

Os ativos são negociados nos mercados de renda fixa, renda variável, commodities, moedas e derivativos, locais e internacionais, sempre sob uma perspectiva de preservação de capital e pela busca de oportunidades de médio e longo prazos, através da identificação de novas estratégias quantitativas.

Recomenda-se a leitura atenta do regulamento do fundo.

Dados Bancários

Favorecido	ENTERCAPITAL TURING FIC FIM
CNPJ	34.626.199/0001-80
Banco	BANCO BRADESCO S.A. (237)
Agência	2856
C/C	29556-6

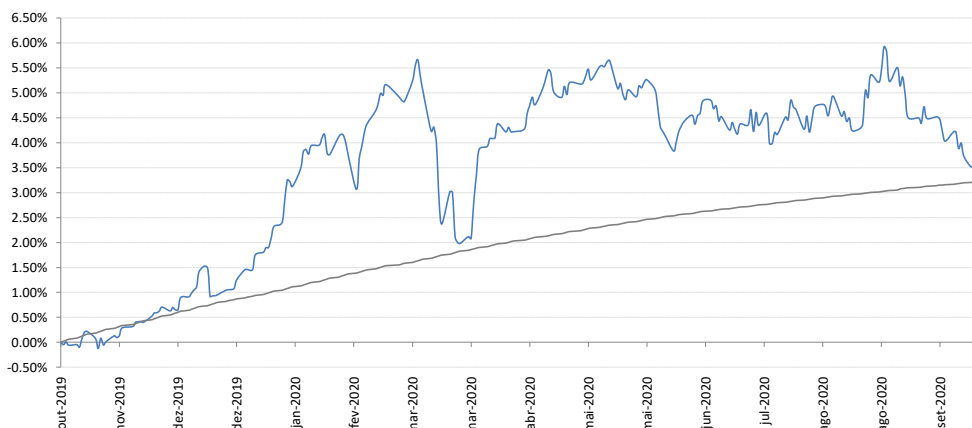
Informações Gerais

Administrador
BEM DTVM
Gestor
EnterCapital Gestão de Recursos Ltda
Custódia
BEM DTVM
Público Alvo
Investidores em geral
Auditor
Pricewaterhousecoopers
Taxa de Administração
2.00%
Aplicação Inicial
R\$ 1,000.00
Movimentação Mínima
R\$ 1,000.00
Saldo Mínimo de Permanência
R\$ 1,000.00
Horário de Movimentação
12:30

Início do Fundo
22/out/19
Início da Atual Gestão
22/out/19
Categoria Anbima
Multimercado Livre
Cota
Fechamento
Tributação
Longo Prazo
Taxa de Performance
20%
Aplicação - Cotização
D+1 dia útil após a data de aplicação
Solicitação de Resgate
A qualquer momento (sem carência)
Resgate - Cotização
D+15 dias corridos
Resgate - Pagamento
D+1 dia útil após a data de cotização

Volatilidade Objetivo
6% - 8% a.a.

Gráfico de Rentabilidade - ENTERCAPITAL TURING FIC FIM



Estatísticas

PL atual Fundo Master	R\$ 103,068,279
PL do Fundo em 30/set/2020	R\$ 83,479,057
PL médio desde o início	R\$ 50,975,160
Retorno Acumulado	3.60%
CDI Acumulado	3.22%
Retorno Médio Mensal	0.30%
Volatilidade anualizada	3.90%
Sharpe	0.10
Número de meses negativos	3
Número de meses positivos	9
Número de meses abaixo do CDI	4
Número de meses acima do CDI	8
Maior rentabilidade mensal	2.27%
Menor rentabilidade mensal	-1.81%

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
Fundo	2.27%	1.02%	(0.72%)	1.08%	0.05%	(0.81%)	0.30%	0.75%	(1.81%)	-	-	-	2.11%	3.60%
% CDI+ (mês)	1.90%	0.73%	-1.06%	0.80%	-0.19%	-1.03%	0.11%	0.59%	-1.97%	-	-	-	-0.18%	0.37%
% CDI	0.38%	0.29%	0.34%	0.28%	0.24%	0.22%	0.19%	0.16%	0.16%	-	-	-	2.29%	3.22%
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.21%	0.50%	0.75%	1.46%	1.46%
% CDI+ (mês)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.06%	0.11%	0.37%	0.55%	0.55%
% CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.15%	0.38%	0.38%	0.91%	0.91%



Contribuição Classe de Estratégia em SET/2020

Momentum Based Trend Following	(0.70%)
Relative Value Fundamentalista	(0.08%)
Relative Value Estatístico	(0.26%)
Time Series Based Trend Following	(0.08%)
Price Action Patterns	(0.23%)
Condition Variable	0.00%
Cash, Costs and Borrow	(0.15%)
Event Driven	(0.43%)
Options Overlay	0.13%
Total	(1.81%)

CONTATO COMERCIAL

Artur Ignarra	EnterCapital Gestão de Recursos www.entercapital.com.br
+55 (11) 2372-1391	Rua George Ohm, 206, 74A São Paulo - SP CEP 04576-020
artur@entercapital.com.br	Tel: +55 11 2372-1391 contato@entercapital.com.br



As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Regulamento do fundo, disponível em www.entercapital.com.br/fundos. As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada. **A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA.** A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de resgate antecipado. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo fundo ga rantidor de crédito (FGC). Leia a lâmina de informações essenciais e o regulamento do fundo antes de investir.