

FATOR VERITÀ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO VRTA11

O Fator Verità Fundo de Investimento Imobiliário tem como objetivo a aquisição de ativos financeiro de base imobiliária, como Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRI), Letra de Crédito Imobiliário (LCI), Letras Hipotecárias (LH), Quotas de FII, Quotas de FIDC, Quotas de FI Renda Fixa e Debêntures, permitindo o melhor acesso a investimentos neste tipo de ativo por aceitar valor menor de investimento.

A distribuição de rendimentos será semestral com base nos meses de junho e dezembro, de acordo com o Parágrafo Primeiro do Artigo 16 do Regulamento do Fundo.

O Benchmark do fundo, em base anual, é de IGP-M + 6% a.a.

A captação do fundo teve início no dia 29 de julho de 2010 com encerramento após 6 meses de distribuição das quotas, o que se deu no dia 31 de janeiro de 2011. O registro de funcionamento do fundo foi concedido pela CVM ao Fator Verità FII no dia 24 de março de 2011.

PRINCIPAIS CARACTERÍSTICAS

Nome do Fundo	Fator Verità FII
Administrador e Gestor	Banco Fator
Custodiante e Escriturador	Banco Itaú
Auditor	KPMG (ex-BDO Trevisan)
Código Bovespa	VRTA11

POSIÇÃO DO FUNDO EM 30/09/2011*

Nome do Fundo	Fator Verità FII
Valor Atual do Patrimônio do Fundo (R\$)	32.158.390,55
Valor Patrimonial das Cotas (R\$)	111,113612
Rentabilidade de Setembro/11 (%)	1,0872%
Rentabilidade em Setembro (IGP-M + %)	IGP-M + 0,44%
Rentabilidade de Setembro anualizada (IGP-M + % a.a.) ⁽²⁾	IGP-M + 5,40% a.a.
Rentabilidade Acumulada - Jan ⁽¹⁾ a Set 2011 (IGP-M+% a.a.)	IGP-M + 4,07% a.a.
Rentabilidade Acumulada - Jan ⁽¹⁾ a Set 2011 (% do CDI)	79,26% do CDI

⁽¹⁾ Período a partir de 28/01/2011 data de alocação do fundo.

⁽²⁾ Base 252

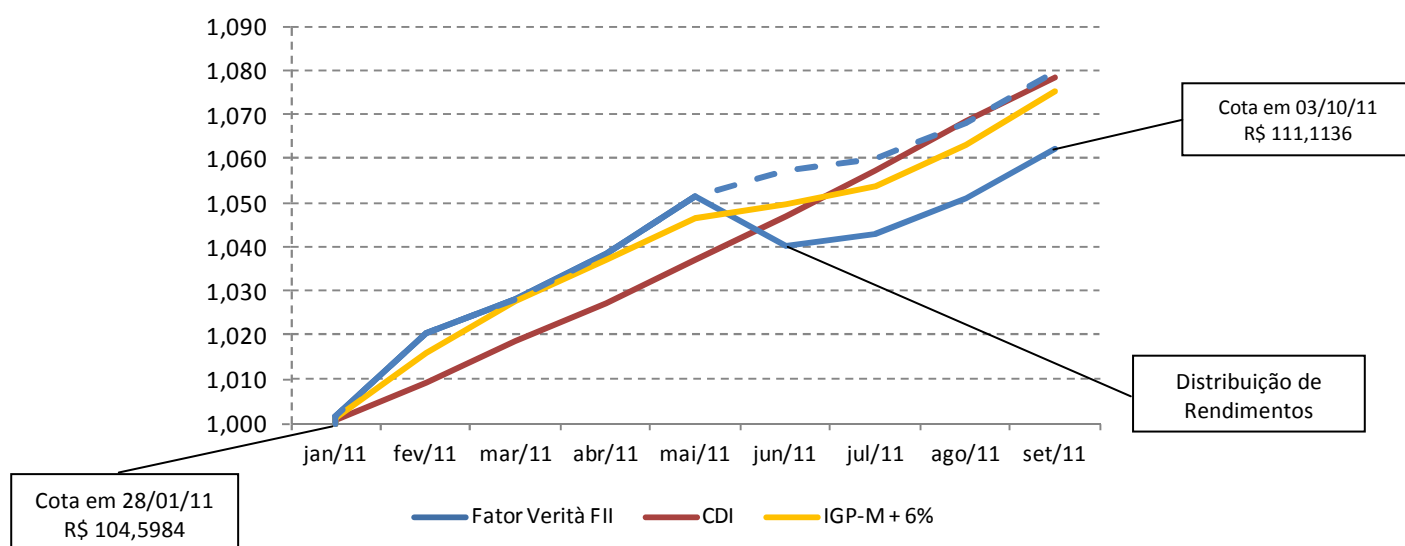
*Carteira base: abertura do dia 03/10/2011

DESEMPENHO MENSAL DO FUNDO

	PL do Fundo	Rentabilidade Mensal da Cota Patrimonial	Cota Patrimonial	Cota Valor de Mercado - BM&FBOVESPA
Março	R\$ 31.124.603,72	0,7733%	R\$ 107,5416	R\$ 110,00
Abril	R\$ 31.434.126,96	0,9945%	R\$ 108,6110	R\$ 108,00
Mai	R\$ 31.832.849,67	1,2684%	R\$ 109,9887	R\$ 111,00
Junho ⁽¹⁾	R\$ 31.493.347,89	-1,0664%	R\$ 108,8158	R\$ 114,90
Julho	R\$ 31.572.581,14	0,2516%	R\$ 109,0895	R\$ 109,00
Agosto	R\$ 31.812.538,38	0,7600%	R\$ 109,9186	R\$ 109,00
Setembro	R\$ 32.158.390,55	1,0900%	R\$ 111,1136	R\$ 107,00

⁽¹⁾ Desempenho de Junho após a distribuição de rendimento

RENTABILIDADE NOMINAL ACUMULADA APÓS O PERÍODO DE DISTRIBUIÇÃO JAN A SET/11 (VERITÀ X CDI X IGP-M+6%)



A linha contínua da rentabilidade do Fator Verità mostra o comportamento das cotas do Fator Verità considerando a distribuição semestral de rendimentos ao cotista. A linha pontilhada desconsidera este efeito.

INVESTIMENTOS REALIZADOS NO PERÍODO

Ativos adquiridos pelo Fundo no mês de referência (Setembro):										
Tipo	Emissor	Emissão	Série	Rating	Indexador	Tx. de Compra	Vencimento	Quantidade	PU de compra	Valor Investido
LCI	Brazilian Mortgages	12/9/2011	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	11/nov/11	415	1.000,00	415.000,00
LCI	Brazilian Mortgages	13/9/2011	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	14/nov/11	700	1.000,00	700.000,00
LCI	Brazilian Mortgages	14/9/2011	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	14/nov/11	460	1.000,00	460.000,00
LCI	Brazilian Mortgages	27/9/2011	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	28/nov/11	300	1.000,00	300.000,00
Valor dos Investimentos do Fundo no Mês										1.875.000,00

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Carteira do Fundo no mês de Setembro:												
Tipo	Emissão	Emissor	Emissão	Série	Rating	Indexador	Tx. de Compra	Vencimento	Quantidade	PU de compra	Valor Líquido	% PL
CRI	Brookfield BTG	GaiaSec	4ª	9ª	AA-	IGP-M	7,60%a.a.	11/nov/16	9	306.925,87	2.242.243,79	6,97%
CRI	Petro Castelo	Brazilian	1ª	185ª	AAA	IGP-M	7,70%a.a.	15/mar/15	6	298.781,48	1.611.692,72	5,01%
CRI	Odebrecht	RB Capital	1ª	40ª	A	IPCA	7,60%a.a.	21/dez/13	4	364.672,03	1.532.870,77	4,77%
CRI	Brookfield CDI	GaiaSec	4ª	16ª	AA+	CDI	1,20%a.a.	9/abr/21	4	302.416,73	1.238.161,63	3,85%
CRI	Gafisa	Brazilian	1ª	177ª	A1.br	CDI	1,20%a.a.	9/set/14	4	314.728,42	1.211.398,89	3,77%
CRI	Pulverizado	Brazilian	1ª	156ª	AA-	IGP-M	8,30%a.a.	13/dez/39	39	333.314,96	11.393.014,54	35,43%
CRI	Brookfield	GaiaSec	1ª	1ª	AA+	IGP-M	8,10%a.a.	9/abr/21	19	237.208,55	3.075.030,54	9,56%
CRI	Pulverizado	Brazilian	1ª	156ª	AA-	IGP-M	8,30%a.a.	13/dez/39	2	333.939,75	584.595,12	1,82%
CRI	Petro Castelo	Brazilian	1ª	185ª	AAA	IGP-M	7,70%a.a.	15/mar/15	1	299.699,32	268.615,45	0,84%
CRI	Pulverizado 180	Brazilian	1ª	180ª	A+	IGP-M	8,00%a.a.	20/ago/40	9	298.779,70	2.391.700,71	7,44%
CRI	Pulverizado Sub.	Brazilian	1ª	157ª	n/a	IGP-M	12,00%a.a.	13/dez/39	3	333.197,59	889.085,37	2,76%
CRI	Pulverizado Sub.	Brazilian	1ª	157ª	n/a	IGP-M	12,00%a.a.	13/dez/39	5	325.372,92	1.480.639,92	4,60%
CRI	Brookfield Sub.	Brazilian	4ª	30ª	n/a	IGP-M	11,50%a.a.	11/out/21	3	335.456,72	1.024.151,98	3,18%
LCI	n/a	Brazilian Mortgages	n/a	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	10/out/11	495	1.000,00	502.729,35	1,56%
LCI	n/a	Brazilian Mortgages	n/a	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	17/out/11	398	1.000,00	403.680,68	1,26%
LCI	n/a	Brazilian Mortgages	n/a	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	11/nov/11	415	1.000,00	417.642,48	1,30%
LCI	n/a	Brazilian Mortgages	n/a	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	14/nov/11	700	1.000,00	704.159,14	2,19%
LCI	n/a	Brazilian Mortgages	n/a	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	14/nov/11	460	1.000,00	462.537,36	1,44%
LCI	n/a	Brazilian Mortgages	n/a	n/a	n/a	CDI	95,00%a.a.	28/nov/11	300	1.000,00	300.508,26	0,93%
FII	Excellence	Brazilian Morgages*	n/a	n/a	n/a	CDI**	105% a.a.**	Indeterminado	2.751	105,00	296.832,90	0,92%
FI RF	n/a	Fator over FI RF	-	-	-	-	-	-	12.675,20	2,57	32.548,96	0,10%
Tesouraria			-	-	-	-	-	-	-	-	38.610,98	0,12%
Contas a pagar/receber			-	-	-	-	-	-	-	-	55.939,04	0,17%
Total Ativos											32.158.390,58	100,00%

*Administrador do Fundo

**Rentabilidade Alvo

DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTO AOS COTISTAS

A política de investimentos do Fator Verità FII define que a periodicidade de distribuição de rendimentos do fundo, a critério do Gestor, será realizada semestralmente.

Mês	R\$/cota	Rentabilidade ⁽¹⁾
jan/11	-	-
fev/11	-	-
mar/11	-	-
abr/11	-	-
mai/11	-	-
jun/11	1,787626	1,79%
jul/11	-	-
ago/11	-	-
set/11	-	-

⁽¹⁾ Rentabilidade = valor distribuído/valor de face das cotas (valor de emissão: R\$ 100,00)

RELACIONAMENTO COM COTISTA

Paulo Vellani

plima@bancofator.com.br

11 3049-6195

Vanessa Roveri

vroveri@bancofator.com.br

11 3049-6257

