

## M CA II FIQ de FIM CP - Setembro 2020

### M CA II FIQ de FIM CP (Cod Anbid: 421960)

Comentário: No mês, o fundo apresentou retorno de 0,39% equivalente a 247% do CDI. No ano, o fundo apresentou retorno de 3,59% equivalente a 161% do CDI.

Todas as alocações tiveram ganhos. As principais contribuições positivas foram as alocações no FIDC Vale que opera linhas de crédito colateralizado através de contratos com alienação fiduciária de imóveis (pelo menos duas vezes o valor do crédito) e FIDC Veritá que utiliza estratégias de compra de recebíveis performados de diversos players da indústria e do varejo.

Ao longo do mês, recebemos amortização do FIDC Aurum Sr15, Aurum Sr19, Garson Sr8, Libra 2 Sr2, Libra 2 Sr4 e Neocred Sr1, reduzimos alocação no FIDC Intercapital Sr, aumentamos alocação no FIDC Multiplica Sr e iniciamos alocação no FIDC Multiplike Sr.

A carteira está composta com ativos majoritariamente em CDI+ além de possuir um bom nível de subordinação em cada um dos ativos apresentando um carregamento bruto de CDI+3,75%.

### Rentabilidade do Fundo (líquido de taxas) - %

	Janeyro	Feveireiro	Março	Abril	Maior	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro	Ano
<b>2016</b> FUNDO	-	-	-	-	-	-	-	0,96%	1,51%	1,43%	1,30%	1,44%	6,75%
% CDI	-	-	-	-	-	-	-	119%	137%	137%	126%	128%	134%
<b>2017</b> FUNDO	1,35%	1,09%	1,36%	0,94%	1,11%	0,97%	0,95%	0,96%	0,76%	0,76%	0,67%	0,64%	12,18%
% CDI	124%	126%	129%	120%	120%	120%	120%	119%	119%	120%	117%	119%	123%
<b>2018</b> FUNDO	0,70%	0,57%	0,64%	0,62%	0,62%	0,59%	0,63%	0,65%	0,54%	0,63%	0,56%	0,58%	7,60%
% CDI	120%	122%	120%	120%	120%	115%	116%	115%	116%	116%	114%	118%	118%
<b>2019</b> FUNDO	0,63%	0,57%	0,54%	0,60%	0,64%	0,54%	0,66%	0,60%	0,54%	0,58%	0,45%	0,47%	7,03%
% CDI	116%	115%	115%	116%	117%	116%	117%	119%	117%	120%	119%	125%	118%
<b>2020</b> FUNDO	0,47%	0,39%	0,45%	0,39%	0,34%	0,33%	0,38%	0,39%	0,39%	-	-	-	3,59%
% CDI	126%	132%	134%	136%	144%	154%	197%	245%	247%	-	-	-	161%

Início do fundo: 15/08/2016

### Estatísticas

	M CA II	Benchmark
Retorno desde o início	42,86%	33,11%
Retorno Anualizado desde início	9,06%	7,20%
Volatilidade anualizada desde início	0,26%	-
Índice de Sharpe	7,16	-
Maior rentabilidade mensal	1,51%	-
Menor rentabilidade mensal	0,33%	-
Nr. de meses acima do benchmark	50	-
Nr. de meses abaixo do benchmark	0	-
Patrimônio Líquido	R\$ 133.554.705,48	-
Patrimônio Líquido médio (12 meses)	R\$ 129.114.287,87	-
Cota de fechamento do mês	1,4285605	-

### Características Gerais

Movimentação inicial mínima	R\$ 5.000,00
Movimentação mínima	Não há
Saldo mínimo	Não há
Cota de aplicação	D+1
Cota de resgate	D+60
Liquidação do resgate	D+1
Horário para aplicação	13:00
Horário para resgate	13:00
Taxa de administração	1,00% a.a.
Taxa de performance	Não há
I.R.	Longo Prazo

### Resumo Carteira

	Financeiro(R\$)	%
VALER FIDC SR	31.254.286,06	23,38
VERITA FIDC SR	25.860.650,61	19,35
MULTIPLICA FIDC SR	13.776.500,51	10,31
VELAR FIDC SR 8	13.376.440,39	10,01
VALE FIDC SR	11.280.121,22	8,44
VALE FIDC SR II	8.887.938,55	6,65
FIDC MULTIPLIKE SR 1	6.906.521,76	5,17
VALE 40 FIC FIDC SR	6.731.411,45	5,04
FIDC AURUM SR 19	5.583.815,15	4,18
Outros	10.005.588,74	7,49

### Informações adicionais:

### Público Alvo

Público-alvo: Investimentos de pessoas físicas e/ou jurídicas, bem como de fundos de investimento e/ou fundos de investimento em quotas, desde que classificados como investidores qualificados, nos termos da legislação vigente.

### Objetivo do Fundo

Realizar os investimentos de seus recursos em uma carteira de investimentos composta, preponderantemente, direta ou indiretamente, por fundos de investimento em direitos creditórios e fundos de investimento em cotas de fundos de investimento em direitos creditórios.

### Características do Fundo

Classificação ANBIMA	Multimercados Estratégia Específica
Gestor	More Invest Gestora de Recursos Ltda.
Administrador	BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM.

