

M CA FIQ de FIM CP - Setembro 2020

M CA FIQ de FIM CP (Cod Anbid: 367771)

Comentário: No mês, o fundo apresentou retorno de 0,37% equivalente a 236% do CDI. No ano, o fundo apresentou retorno de 3,51% equivalente a 157% 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, reduzimos alocação no FIDC Multiplica Sr e iniciamos alocação no FIDC Multiplike Sr.

A carteira está composta por ativos majoritariamente em CDI+ além de possuir um bom nível de subordinação em cada um dos ativos apresentando um carregamento bruto de CDI+3,35%

Importante destacar que o fundo reabriu para novas captações pelo prazo de 30 dias a partir do dia 23 de setembro ou até atingir o patrimônio líquido de R\$200.000.000,00 (o que ocorrer primeiro).

Rentabilidade do Fundo (líquido de taxas) - %

		Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro	Ano
2014	FUNDO	0,41%	0,90%	0,93%	1,03%	1,07%	1,04%	1,15%	1,06%	1,11%	1,16%	1,03%	1,18%	12,77%
	% CDI	105%	114%	123%	127%	125%	127%	123%	124%	123%	123%	123%	123%	124%
2015	FUNDO	1,15%	1,03%	1,31%	1,18%	1,25%	1,36%	1,49%	1,38%	1,35%	1,38%	1,33%	1,49%	16,89%
	% CDI	123%	125%	126%	124%	127%	128%	127%	117%	122%	125%	126%	128%	128%
2016	FUNDO	1,35%	1,25%	1,40%	1,30%	1,37%	1,41%	1,30%	1,45%	1,30%	1,23%	1,24%	1,34%	17,16%
	% CDI	128%	124%	121%	123%	123%	122%	118%	120%	118%	117%	119%	119%	123%
2017	FUNDO	1,31%	1,02%	1,30%	0,92%	1,08%	0,93%	0,92%	0,91%	0,73%	0,76%	0,67%	0,64%	11,78%
	% CDI	121%	118%	124%	117%	116%	115%	115%	114%	115%	118%	118%	118%	119%
2018	FUNDO	0,70%	0,55%	0,62%	0,59%	0,59%	0,57%	0,62%	0,65%	0,53%	0,63%	0,56%	0,57%	7,42%
	% CDI	120%	119%	116%	115%	114%	111%	114%	114%	114%	115%	114%	115%	116%
2019	FUNDO	0,62%	0,57%	0,54%	0,60%	0,63%	0,54%	0,66%	0,58%	0,54%	0,55%	0,44%	0,45%	6,92%
	% CDI	115%	115%	115%	115%	115%	116%	116%	115%	116%	115%	116%	120%	116%
2020	FUNDO	0,46%	0,38%	0,45%	0,38%	0,33%	0,32%	0,38%	0,39%	0,37%	-	-	-	3,51%
	% CDI	123%	130%	132%	132%	139%	151%	194%	243%	236%	-	-	-	157%

Início do fundo: 17/01/2014

Estatísticas

	M CA	Benchmark
Retorno desde o início	105,22%	80,46%
Retorno Anualizado desde início	11,37%	9,24%
Volatilidade Anualizada desde início	0,42%	-
Índice de Sharpe	5,07	-
Maior rentabilidade mensal	1,49%	-
Menor rentabilidade mensal	0,32%	-
Nr. de meses acima do benchmark	81	-
Nr. de meses abaixo do benchmark	0	-
Patrimônio Líquido	R\$ 119.262.903,80	-
Patrimônio Líquido médio (12 meses)	R\$ 149.739.527,05	-
Cota de fechamento do mês	2,0521988	-

Características Gerais

Movimentação inicial mínima	R\$ 5.000,00
Movimentação mínima	R\$ 5.000,00
Saldo mínimo	Não há
Cota de aplicação	D+1
Cota de resgate	D+30
Liquidação do resgate	D+1
Horário para aplicação	13:00
Horário para resgate	13:00
Taxa de administração	0,50% a.a.
Taxa de performance	Não há
I.R.	Longo Prazo

Resumo Carteira

	Financeiro(R\$)	%
M CA II FIC FIM CP	33.097.027,32	27,72
VERITA FIDC SR	25.386.909,26	21,26
VALE FIDC SR	21.406.111,48	17,93
MULTIPLICA FIDC SR	14.904.771,66	12,48
VALER FIDC SR	12.888.442,27	10,79
VELAR FIDC SR 8	4.182.946,77	3,50
TESOURO SELIC FI RF	2.612.447,80	2,19
VALE FIDC SR II	2.212.842,28	1,85
FIDC MULTIPLIKE SR 1	2.000.574,39	1,68
Outros	708.902,80	0,59

Informações adicionais:

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.

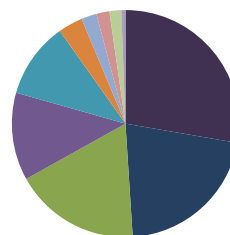
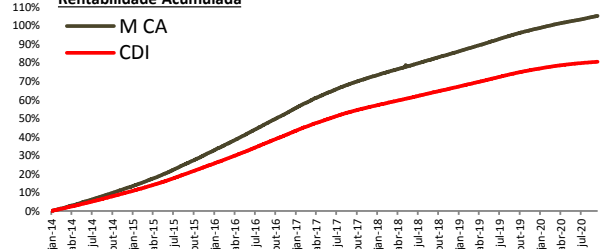
Objetivo do Fundo

Através de uma carteira de investimentos diferenciada, proporcionar uma rentabilidade ligeiramente superior aos instrumentos tradicionais de renda fixa.

Características do Fundo

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

Rentabilidade Acumulada



■ M CA II FIC FIM CP	■ VERITA FIDC SR
■ VALE FIDC SR	■ MULTIPLICA FIDC SR
■ VALER FIDC SR	■ VELAR FIDC SR 8
■ TESOURO SELIC FI RF	■ VALE FIDC SR II
■ FIDC MULTIPLIKE SR 1	■ Outros