

M CA FIQ de FIM CP - Outubro 2020

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

Comentário: No mês, o fundo apresentou retorno de 0,39% equivalente a 249% do CDI. No ano, o fundo apresentou retorno de 3,91% equivalente a 164% do CDI.

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, não tivemos alterações relevantes.

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+3,60%

Importante destacar que o fundo fechou para novas captações a partir do dia 23 de outubro de 2020.

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%	0,39%	-	-	3,91%
% CDI	123%	130%	132%	132%	139%	151%	194%	243%	236%	249%	-	-	164%

Início do fundo: 17/01/2014

Estatísticas

	M CA	Benchmark
Retorno desde o início	106,02%	80,74%
Retorno Anualizado desde início	11,28%	9,15%
Volatilidade Anualizada desde início	0,42%	-
Índice de Sharpe	5,10	-
Maior rentabilidade mensal	1,49%	-
Menor rentabilidade mensal	0,32%	-
Nr. de meses acima do benchmark	82	-
Nr. de meses abaixo do benchmark	0	-
Patrimônio Líquido	R\$ 122.228.075,51	-
Patrimônio Líquido médio (12 meses)	R\$ 143.961.128,41	-
Cota de fechamento do mês	2,0602139	-

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	33.225.260,42	27,09
VERITA FIDC SR	25.509.999,94	20,80
VALE FIDC SR	21.509.900,92	17,54
MULTIPLICA FIDC SR	14.964.984,73	12,20
VALER FIDC SR	13.978.825,31	11,40
TESOURO SELIC FI RF	4.298.529,05	3,51
VELAR FIDC SR 8	4.203.228,16	3,43
VALE FIDC SR II	2.223.571,44	1,81
FIDC MULTIPLIKE SR 1	2.012.674,72	1,64
Outros	710.677,21	0,58

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

