

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

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

Comentário: No mês, o fundo apresentou retorno de 0,43% equivalente a 259% do CDI. No ano, o fundo apresentou retorno de 4,83% equivalente a 180% do CDI.

Todas as alocações tiveram ganhos. As principais contribuições positivas foram as alocações no FIDC Valer e FIDC Veritá que utilizam estratégias de compra de recebíveis performados de diversos players da indústria e do varejo.

Ao longo do mês, recebemos amortização do FIDC Neocred Sr1 e Aurum Sr19, aumentamos alocação no FIDC Multiplica Sr e FIDC Multiplike Sr e reduzimos alocação no FIDC RDF Sr, FIDC Evolve Sr e FIDC Valer 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+4,1%.

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

		Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro	Ano
2016	FUNDO	-	-	-	-	-	-	-	0,96%	1,51%	1,43%	1,30%	1,44%	6,75%
	% CDI	-	-	-	-	-	-	-	119%	137%	137%	126%	128%	134%
2017	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%
2018	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%
2019	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%
2020	FUNDO	0,47%	0,39%	0,45%	0,39%	0,34%	0,33%	0,38%	0,39%	0,39%	0,39%	0,38%	0,43%	4,83%
	% CDI	126%	132%	134%	136%	144%	154%	197%	245%	247%	247%	269%	259%	180%

Início do fundo: 15/08/2016

### Estatísticas

	M CA II	Benchmark
Retorno desde o início	44,57%	33,70%
Retorno Anualizado desde início	8,86%	6,92%
Volatilidade anualizada desde início	0,27%	-
Índice de Sharpe	7,30	-
Maior rentabilidade mensal	1,51%	-
Menor rentabilidade mensal	0,33%	-
Nr. de meses acima do benchmark	53	-
Nr. de meses abaixo do benchmark	0	-
Patrimônio Líquido	R\$ 134.791.580,76	-
Patrimônio Líquido médio (12 meses)	R\$ 129.669.310,15	-
Cota de fechamento do mês	1,4457058	-

### 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	32.408.708,51	24,51
VERITA FIDC SR	25.986.038,28	19,65
MULTIPLICA FIDC SR	13.832.155,54	10,46
VELAR FIDC SR 8	13.441.297,24	10,17
VALE FIDC SR	11.334.813,89	8,57
VALE FIDC SR II	8.931.032,51	6,75
VALE 40 FIC FIDC SR	6.769.445,47	5,12
FIDC MULTIPLIKE SR 1	5.846.082,06	4,42
FIDC AURUM SR 19	5.609.763,57	4,24
Outros	8.071.457,65	6,10

### Informações adicionais:

### Público Alvo

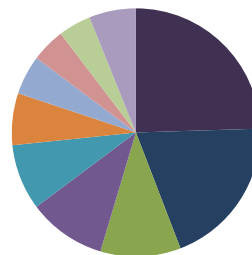
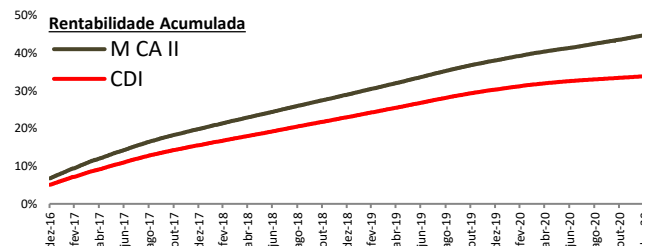
Público-alvo: Investimentos de pessoas físicas e/ou jurídicas, bem como de fundos de investimento e/ou fundos de investimento em quotas, desde que classificados como investidores qualificados, nos termos da legislação vigente.

### 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.



■ VALER FIDC SR
■ VERITA FIDC SR
■ MULTIPLICA FIDC SR
■ VELAR FIDC SR 8
■ VALE FIDC SR
■ VALE FIDC SR II
■ VALE 40 FIC FIDC SR
■ FIDC MULTIPLIKE SR 1
■ FIDC AURUM SR 19
■ Outros