

Carta Mensal aos Cotistas

CAIXA FIC EXPERT SPX NIMITZ MM

Material de Divulgação

Julho / 2024

Comentário do Gestor

Seguem nossas alocações

No mercado de juros, seguimos com posições aplicadas em países onde vemos espaço para os bancos centrais reduzirem o nível de restrição monetária. Nos mercados de moedas, temos posições adequadas a um cenário de desaceleração global com pouca exposição ao dólar americano. No book de ações, estamos com posições relativas e baixo direcional. Nas commodities, estamos com posições vendidas em grãos e em metais industriais, além de posições compradas em metais preciosos. No portfólio de crédito desenvolvido, seguimos com leve exposição comprada em papéis High Yields. Nos mercados de crédito emergente, estamos com posições em ativos de crédito idiossincráticos High Yield e de reestruturação.

Atribuição de Performance

No mês de julho, o SPX Nimitz apresentou um retorno de +2,44%, enquanto seu benchmark, CDI, obteve o retorno de +0,91% no mesmo período. No ano, o fundo acumulou uma rentabilidade de +4,78%, enquanto o CDI apresentou +6,18%. No mês, as contribuições positivas para o fundo vieram das alocações em juros, crédito e commodities, enquanto as posições em ações e moedas apresentaram contribuições neutras no mês.

RAZÕES PARA INVESTIR

O objetivo do fundo é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem em ativos financeiros de diferentes naturezas, riscos e características, definindo as estratégias de investimento com base em cenários macroeconômicos de médio e longo prazo, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial.

Fundo voltado à investidores com perfil agressivo, que possuem horizonte de investimento de longo prazo e que desejam diversificar seus investimentos

OBJETIVO DE INVESTIMENTO

O fundo tem como objetivo replicar, na modalidade de fundo espelho, a estratégia do SPX NIMITZ MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (CNPJ 12.798.221/0001-36)

CLASSIFICAÇÃO DE RISCO



PERFORMANCE (36 meses)



RENTABILIDADE (%)

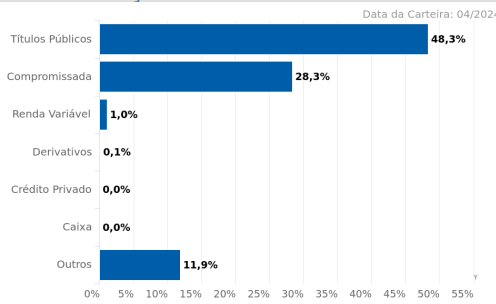
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Histórico	Fundo (%)	%CDI
2024														06 m	4,43	85,9
Fundo (%)	0,33	0,42	1,31	-1,00	-0,37	1,61	2,42						4,78	12 m	7,96	69,2
%CDI	34,3	52,6	157,7	-	-	203,9	266,5						77,3	24 m	4,39	16,5
2023														36 m	35,06	90,9
Fundo (%)	1,86	0,42	-0,69	0,40	-0,84	-3,30	-2,17	1,56	0,50	0,19	-0,85	1,63	-1,41	48 m	44,45	106,0
%CDI	165,7	45,8	-	43,7	-	-	-	136,7	51,5	18,9	-	181,4	-			
2022																
Fundo (%)	2,28	3,04	7,31	3,51	1,35	2,36	-1,16	2,13	5,13	-0,86	-5,12	0,07	21,31			
%CDI	311,0	406,0	791,7	420,9	130,9	232,7	-	182,2	478,2	-	-	5,8	172,2			
2021																
Fundo (%)	-0,67	5,35	2,54	-0,05	-0,56	0,30	-3,13	0,30	3,68	1,70	0,14	1,78	11,68			
%CDI	-	3.976,0	1.282,2	-	-	99,7	-	70,1	840,3	353,7	23,6	232,5	265,8			

MERCADO DE ATUAÇÃO

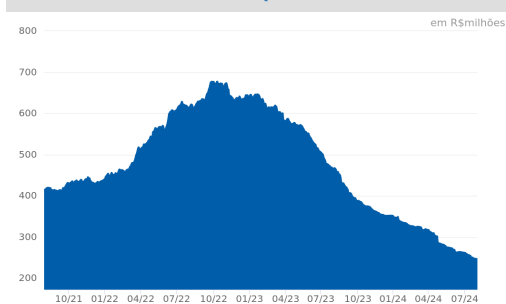
TÍTULOS PÚBLICOS	CRÉDITO PRIVADO
PÓSFIXADO	AÇÕES
PREFIXADO	MOEDAS
INFLAÇÃO	INVESTIMENTO EXTERIOR
COTAS DE FUNDOS	OUTROS

ATUA NÃO ATUA

ALOCÇÃO POR CLASSE DE ATIVOS



PATRIMÔNIO LÍQUIDO (36 meses)



CARACTERÍSTICAS

CNPJ:	34.660.453/0001-66	Aplicação Inicial:	R\$ 10.000,00
Gestão:	CAIXA DTVM	Saldo Mínimo:	R\$ 25.000,00
Administrador:	Caixa Econômica Federal	Resgate Mínimo:	R\$ 100,00
Classificação Anbima:	Multimercados Macro	Aplicação (déb./conv.):	D+0 / D+1
Tributação:	Longo Prazo	Resgate (conv./créd.):	D+44 / D+46
Cota Utilizada:	Fechamento	Horário limite:	13:00
Início do Fundo:	04/05/2020	Volatilidade (12m):	3,13%
Taxa de Administração:	2%	Patrimônio Líquido em 31/07/2024:	R\$ 246.786.062,07
Taxa de Administração (Máxima):	2%	PL Médio de 12 meses:	R\$ 335.448.876,51
Taxa de Performance:	Não há	Classificação de Risco:	Moderado
Público-Alvo:	Fundo destinado às pessoas físicas e pessoas jurídicas considerados investidores qualificados.	Escala de Influência ASG:	Não se aplica



Material de Divulgação. Leia sempre o Regulamento e a lâmina de informações essenciais, se houver, antes de investir. O investimento em Fundo não é garantido pelo Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados Futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Este fundo não possui uma política de investimentos que busca originar benefícios ambientais, sociais ou de governança. A utilização do índice de referência para comparativo da rentabilidade é mera referência e não parâmetro do Fundo. As características de movimentação apresentadas são válidas na data da posição deste documento, podendo sofrer alterações à critério da Administradora. As informações sobre o Fundo estão disponíveis nas agências CAIXA ou no endereço www.caixa.gov.br. SAC: 08007260101. Ouvidoria: 0800-725-7474, Alô CAIXA:4004 0104 (Capitais e Regiões Metropolitanas), 08001040104 (Demais Regiões) Central de Atendimento a Pessoas com Deficiência Auditiva e de Fala: 0800-726-2492.

