

Objetivo

O objetivo do fundo é proporcionar rentabilidade referenciada à variação do Certificado de Depósito Interbancário (CDI), no médio e longo prazo, através da adoção de estratégias de investimentos centradas nos mercados de títulos de renda fixa públicos e privados (pré e pós-fixados) e em mercados organizados de liquidação futura de taxas de juros, respeitando os limites observados na legislação em vigor e no regulamento do fundo.

Público Alvo

Fundo Aberto, destinado ao público em geral, observados os valores mínimos de aplicação inicial, permanência e movimentação constantes no prospecto.

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Grau de Invest.
Gestor: CA Indosuez

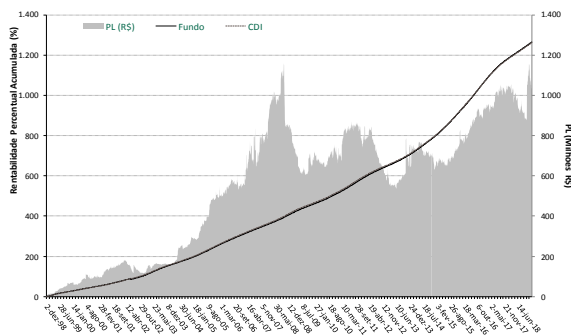
Admite Alavancagem: Não
Administrador: CA Indosuez

Custodiante: BRADESCO
Auditoria: Ernst & Young

Características

Data de início	02/12/1998
Patrimônio líquido (R\$)	1.037.301.077
Patrimônio líquido médio em 12 meses (R\$)	991.869.647
Investimento Inicial Mínimo (R\$)	1.000
Movimentação mínima (R\$)	1.000
Saldo Mínimo (R\$)	1.000
Taxa de saída antecipada	Não há
Taxa de administração	0,30% a.a.
Taxa de performance	Não tem
Aplicações	Diárias (dias úteis) até às 14:30h, cotas em D+0.
Resgates	Diárias (dias úteis) até às 14:30h, cotas em D+0.
Pagamentos	Diárias (dias úteis) até às 14:30h, recursos em D+0.

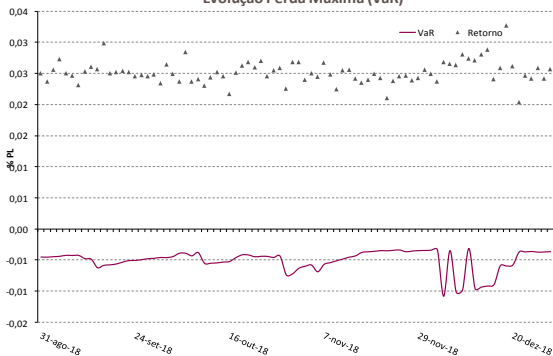
Evolução da Performance e Patrimônio Líquido



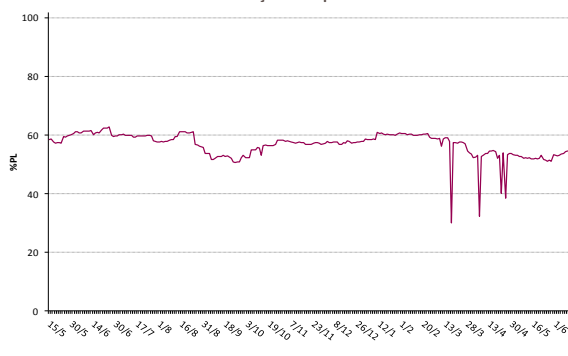
Performance e Diferencial do Benchmark (%)

	jan-18	fev-18	mar-18	abr-18	mai-18	jun-18	jul-18	ago-18	set-18	out-18	nov-18	dez-18	Ano	12 Meses	24 Meses	Início
Fundo	0,58	0,46	0,52	0,54	0,50	0,51	0,54	0,57	0,48	0,55	0,49	0,52	6,45	6,45	17,27	1.265,57
Benchmark	0,58	0,47	0,53	0,52	0,52	0,52	0,54	0,57	0,47	0,54	0,49	0,49	6,42	6,42	17,01	1.262,13
% CDI	98,89	98,89	98,39	103,94	96,88	98,55	100,27	100,91	102,52	102,11	98,86	105,85	100,47	100,47	101,36	100,10

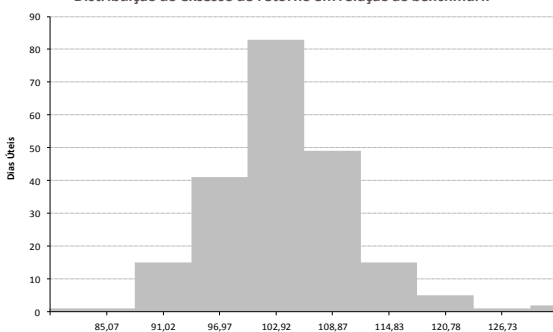
Evolução Perda Máxima (VaR)



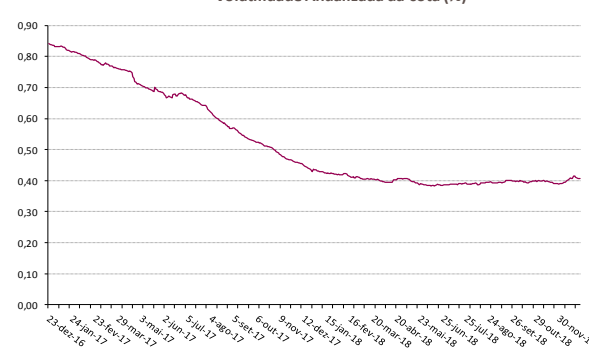
Evolução da Liquidez



Distribuição do excesso de retorno em relação ao benchmark *



Volatilidade Anualizada da cota (%)



- Este material é meramente informativo e circulação privada, não devendo ser considerado como recomendação de investimento ou oferta para a aquisição de cotas de Fundos ou outros investimentos, nem deve servir como base única para tomada de decisão de investimento. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Leia o prospecto e o regulamento antes de investir. Em caso de dúvida, fale com o seu Gerente de Relacionamento. As aplicações em Fundos de Investimento estão sujeitas a riscos e os Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito - FGC.

- A CA Indosuez DTVM certifica que as visões expressas nesse relatório foram elaboradas de forma independente e autônoma. As informações aqui apresentadas são obtidas de fontes consideradas confiáveis. Esse relatório não pode ser reproduzido ou distribuído sem a expressa anuência da CA Indosuez DTVM.

Métricas de Risco de Mercado (%PL)

VaR	-0,004
Stress Testing - Pior Cenário	-0,046
Maior Fator de Risco	CDI

Outras Informações

Número de meses negativos *	0
Número de meses positivos *	12
Número de meses acima do Benchmark *	6
Número de meses abaixo do Benchmark *	6
Maior rentabilidade mensal *	0,58
Menor rentabilidade mensal *	0,46
Maximum Draw Down (%) *	-
Time to Recover (dias úteis) *	-
Prazo Médio DC	1.017



* Janela de análise: 12 meses

Contatos

São Paulo: |Al. Itú, 852 - 16º andar | CEP:01421-001 | Tel: (11) 3896-6300 | Fax: (11) 3896-6363 | **São Paulo / Dist. Externa:** |Al. Itú, 852 - 16º andar | CEP:01421-001 | Tel: (11) 3896-6248 | Tel: (11) 3896-6320 | Fax: (11) 3896-6363 | **Rio de Janeiro:** |Avenida Rio Branco, 1 - sala 707 | CEP: 20090-003 | Tel:(21) 2106-6200 | Fax: (21) 2106-6262 | **Supervisão e Fiscalização:** Comissão de Valores Mobiliários (CVM) | Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br | **Ouvidoria:** Tel: 0800 724 2818 - Fax: (11) 3896-2818 - E-mail: ouvidoria@ca-cib.com | www.creditagricoledtvm.com.br |