

CNPJ
23.883.385/0001-88

Nome do fundo
AZ QUEST PREV ICATU LUCE FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO

Gestor
AZ QUEST MZK INVESTIMENTOS MACRO E CRÉDITO LTDA.

Administrador
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.

Custodiante
BNY MELLON BANCO S.A.

Auditor independente
DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência RF Duração Livre Crédito Liv
Classificação CVM Fundo de Renda Fixa
Código Anbima 423572
Código ISIN BRAZ00CTF005
Lançamento 09/09/2016
Benchmark CDI

Cota Fechamento
Depósito em D+0 Cota em D+0
Resgate (Dias úteis) Cota em D+1
Liquidação em D+3 Pagamento de acordo com o prazo dos planos*

Taxa de administração Máxima: 1,00%
Efetiva: 1,00%
Mínima: 0,00%

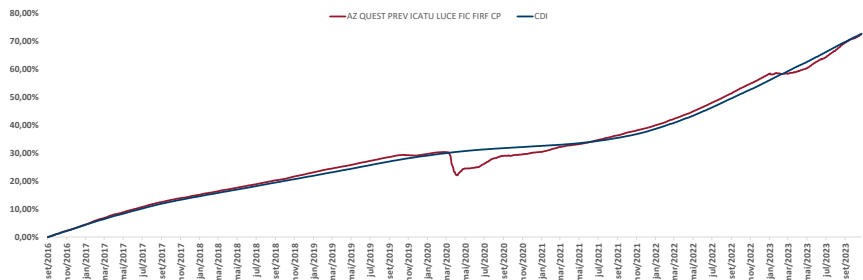
Taxa de performance Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
A política de investimento consiste em acompanhar de forma correlata a variação da taxa de juros no mercado interbancário, utilizando-se de instrumentos no mercado à vista e de derivativos, disponíveis nos mercados financeiros e de capitais, de acordo com as restrições previstas na legislação vigente, com o objetivo de acompanhar o CDI.

Público Alvo

O Fundo destina-se exclusivamente a receber, diretamente ou por meio dos seus Fundos de Investimento, recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre – PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre – VGBL (conjuntamente os “Planos”), disciplinados pela Resolução do Conselho Monetário Nacional no 4.444 de 13.11.2015 (Res. CMN no 4.444/15), destinados a proponentes não qualificados, instituídos pela Icatu Seguros S.A., doravante designado Cotista ou Instituidora, Investidor Profissional nos termos da Instrução CVM no 539, de 13.11.2013 (ICVM 539/13) e posteriores alterações.

Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2019	Fundo	0,64%	0,53%	0,49%	0,49%	0,62%	0,49%	0,57%	0,57%	0,52%	0,13%	-0,09%	0,34%	5,43%	29,57%
	Benchmark	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%	0,48%	0,38%	0,37%	5,96%	28,98%
2020	Fundo	117,36%	107,68%	103,76%	94,78%	114,34%	104,84%	101,13%	114,53%	111,38%	26,95%	-21,77%	90,45%	91,04%	102,04%
	Benchmark	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,31%	0,24%	0,19%	0,16%	0,16%	0,15%	0,15%	0,16%	0,63%	30,39%
2021	Fundo	0,47%	0,70%	0,60%	0,28%	0,44%	0,60%	0,61%	0,61%	0,63%	0,60%	0,61%	0,71%	7,08%	39,63%
	Benchmark	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	4,42%	38,40%
2022	Fundo	0,75%	0,84%	0,93%	0,87%	1,09%	1,09%	1,04%	1,20%	1,19%	1,07%	1,06%	1,17%	13,02%	57,81%
	Benchmark	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,12%	1,12%	12,39%	55,55%
2023	Fundo	102,47%	111,83%	99,86%	104,01%	105,08%	107,79%	100,36%	103,00%	110,97%	104,56%	104,06%	104,57%	105,10%	104,07%
	Benchmark	0,56%	-0,18%	0,27%	0,72%	1,31%	1,07%	1,38%	1,68%	1,17%	1,04%			9,37%	72,61%
	%CDI	50,15%	-19,71%	22,95%	78,52%	116,74%	100,04%	128,65%	147,32%	120,00%	103,76%			85,05%	99,88%

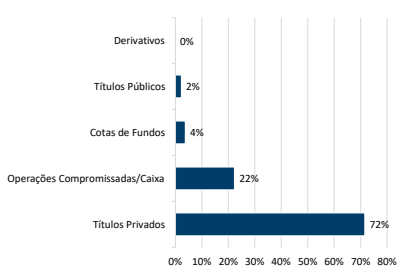
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	1	4
Nº Meses >0	11	81
Nº Meses <Benchmark	4	19
Nº Meses >Benchmark	8	66
Maior Rentabilidade Mensal	1,68%	1,68%
Menor Rentabilidade Mensal	-0,18%	-4,33%
Maximum Drawdown	0,32%	6,39%
Volatilidade Anualizada	0,61%	0,82%
Índice de Sharpe	-2,59	-0,04

Rentabilidades Acumuladas

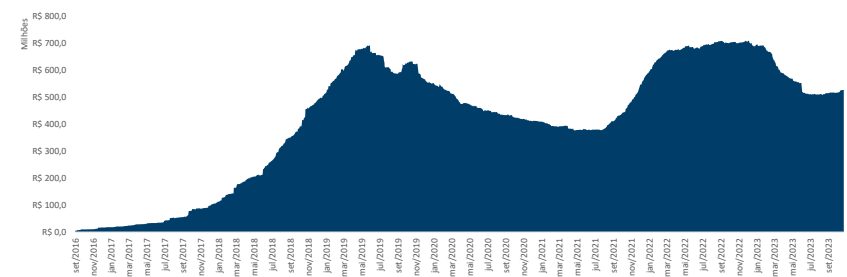
Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	3,93%	3,14%	125,07%
Últimos 6 meses	7,89%	6,55%	120,47%
Últimos 12 meses	11,83%	13,41%	88,22%
Últimos 24 meses	25,25%	26,47%	95,36%
Últimos 36 meses	33,33%	30,71%	108,53%
Últimos 48 meses	33,54%	34,90%	96,08%
Últimos 60 meses	42,17%	43,27%	97,46%
Desde o início	72,61%	72,69%	99,88%

Composição da Carteira***



Data da carteira: out/2023
***Número de aberturas consecutivas: 5

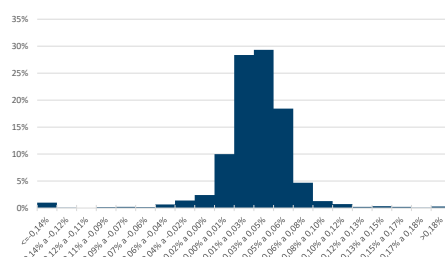
Evolução do Patrimônio Líquido



Patrimônio Líquido

	Atual	R\$
Médio nos últimos 12 meses		R\$ 527.045.602,64
Médio desde o início		R\$ 592.754.380,99
		R\$ 419.177.533,45

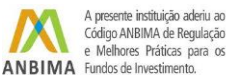
Histograma dos Retornos Diários



Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe***



***Índice calculado a partir da razão entre a média do retorno diário acima do CDI e a volatilidade diária.



* De acordo com as Circulares SUSEP nº 563/564 de 2017, para planos destinados a proponentes varejo e qualificados aprovados a partir de 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é de até 10 (dez) dias úteis e 180 (cento e oitenta) dias úteis, respectivamente, e para planos anteriores a 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é até 5 (cinco) dias úteis. O crédito será efetuado pela Icatu Seguros até o prazo estipulado em norma, a contar do dia útil subsequente ao recebimento do formulário preenchido corretamente e mediante envio da documentação obrigatória solicitada. Os investimentos do Fundo estarão sujeitos a flutuações de mercado e a riscos de crédito. É importante ressaltar que apesar do cuidado e diligência da Icatu Seguros no monitoramento de riscos do Fundo, sempre existe a possibilidade de oscilações superiores às estimativas utilizadas nos sistemas de controle, podendo ocasionar distanciamientos e perdas superiores às esperadas. Desta forma, investimentos no Fundo devem ser sempre considerados como aplicações de risco, tendo em vista a possibilidade de não ser alcançado o objetivo de investimento a que o Fundo se propõe, bem como a possibilidade de perda parcial ou total dos recursos investidos. Investimentos em Fundos que podem sofrer perdas patrimoniais não são garantidos pela Instituição Administradora, pelo Gestor da Carteira nem por qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. É recomendada a leitura cuidadosa do formulário de informações complementares e do regulamento do fundo pelo investidor ao aplicar seus recursos, podendo este ser encontrado em <http://www.cvm.gov.br>. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. A descrição da classificação ANBIMA pode ser encontrada no formulário de informações complementares. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO: Comissão de Valores Mobiliários - CVM (Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br)