

CNPJ
12.823.627/0001-21

Nome do fundo
ICATU VANGUARDA FIC DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA INFLAÇÃO CURTA PREVIDENCIÁRIO

Gestor
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administrador
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.

Custodiante
BANCO BRADESCO S.A.

Auditor independente
ERNST & YOUNG AUDITORES INDEPENDENTES S/S LTDA.

Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência RF Indexados
Classificação CVM Fundo de Renda Fixa
Código Anbima 282499
Código ISIN BRSE02CTF008
Lançamento 25/07/2011
Benchmark IMA-B 5

Cota
Fechamento

Aplicações (Dias úteis)
Depósito em D+0
Cota em D+0

Resgate (Dias úteis)
Liquidação em D+1
Pagamento de acordo com o prazo dos planos*

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

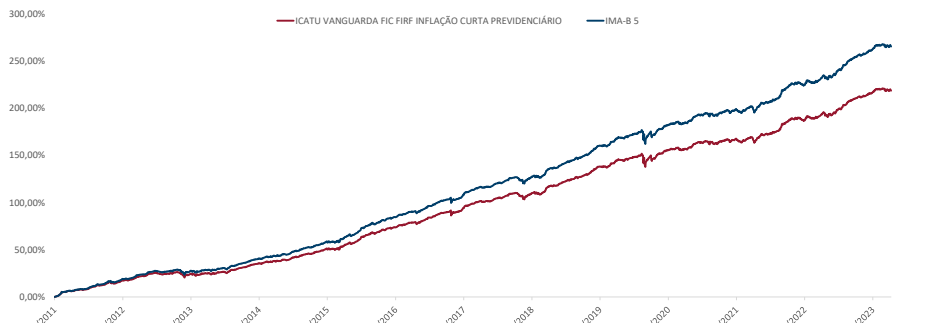
Taxa de performance
Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O FUNDO tem por objetivo acompanhar ou superar a rentabilidade do IMA-B 5, divulgado pela ANDIMA, índice este que é composto por títulos públicos Federais atrelados ao IPCA, com maturidade inferior a cinco anos, que estejam em poder do público, através de investimentos em cotas de fundos de investimento ou cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento de Renda Fixa conforme definição da IN CVM 555 ("FUNDOS INVESTIDOS"), negociados no mercado interno, para tanto, os "FUNDOS INVESTIDOS" poderão alocar seus investimentos em ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados no mercado interno, sendo vedada exposição à renda variável, cambial e alavancagem e desde que respeitadas as regras e os limites impostos pela legislação vigente.

Público Alvo

O Fundo destina-se exclusivamente a receber, diretamente, 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 4.444/15), destinados a proponentes não qualificados, instituídos pela Icatu Seguros S.A, doravante designado Cotista ou Instituidora, considerada Investidora 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	1,47%	0,45%	0,70%	1,01%	1,32%	1,67%	0,86%	-0,05%	1,68%	1,60%	-0,43%	1,16%	12,05%	147,18%
	Benchmark	1,54%	0,55%	0,78%	1,11%	1,39%	1,72%	0,97%	0,05%	1,74%	1,65%	-0,28%	1,24%	13,15%	171,38%
	Dif.	-0,07%	-0,09%	-0,08%	-0,09%	-0,06%	-0,04%	-0,11%	-0,10%	-0,06%	-0,05%	-0,15%	-0,08%	-1,11%	-24,21%
2020	Fundo	0,48%	0,56%	-1,91%	0,43%	2,08%	1,01%	0,95%	0,28%	-0,29%	0,11%	1,25%	1,78%	6,86%	164,13%
	Benchmark	0,56%	0,64%	-1,75%	0,49%	2,12%	1,12%	0,99%	0,43%	-0,12%	0,20%	1,32%	1,83%	8,04%	193,20%
	Dif.	-0,07%	-0,08%	-0,16%	-0,06%	-0,04%	-0,11%	-0,04%	-0,15%	-0,16%	-0,09%	-0,07%	-0,05%	-1,18%	-29,08%
2021	Fundo	0,00%	-0,69%	0,21%	0,81%	0,59%	-0,22%	-0,11%	0,02%	0,89%	-1,30%	2,43%	0,69%	3,33%	172,91%
	Benchmark	0,11%	-0,60%	0,34%	0,87%	0,69%	-0,13%	0,03%	0,15%	1,00%	-1,24%	2,50%	0,79%	4,57%	206,59%
	Dif.	-0,11%	-0,09%	-0,13%	-0,06%	-0,10%	-0,09%	-0,14%	-0,13%	-0,11%	-0,06%	-0,07%	-0,10%	-1,24%	-33,67%
2022	Fundo	0,02%	0,99%	2,50%	1,47%	0,69%	0,26%	-0,07%	-0,06%	0,38%	1,82%	-0,72%	0,85%	8,40%	195,83%
	Benchmark	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%	1,91%	-0,33%	0,94%	9,78%	236,58%
	Dif.	-0,09%	-0,07%	-0,11%	-0,08%	-0,09%	-0,07%	-0,08%	-0,06%	-0,04%	-0,10%	-0,39%	-0,09%	-1,39%	-40,75%
2023	Fundo	1,30%	1,33%	1,43%	0,83%	0,49%	0,94%	0,90%	0,54%	0,08%	-0,39%			7,69%	218,56%
	Benchmark	1,40%	1,41%	1,52%	0,90%	0,57%	1,05%	0,97%	0,61%	0,13%	-0,31%			8,55%	265,36%
	Dif.	-0,09%	-0,08%	-0,09%	-0,07%	-0,09%	-0,11%	-0,07%	-0,07%	-0,05%	-0,08%			-0,87%	-46,80%

Indicadores Risco x Retorno

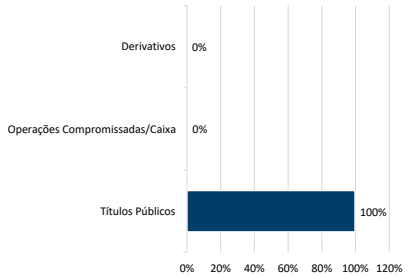
Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	2	25
Nº Meses >0	10	122
Nº Meses <Benchmark	12	147
Nº Meses >Benchmark	0	0
Maior Rentabilidade Mensal	1,43%	3,85%
Menor Rentabilidade Mensal	-0,72%	-1,91%
Maximum Drawdown	1,66%	5,60%
Volatilidade Anualizada	2,38%	3,12%
Índice de Sharpe	-2,36	2,45

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	Dif.
Últimos 3 meses	0,22%	0,43%	-0,21%
Últimos 6 meses	2,57%	3,06%	-0,49%
Últimos 12 meses	7,82%	9,21%	-1,39%
Últimos 24 meses	20,39%	23,11%	-2,72%
Últimos 36 meses	24,28%	28,57%	-4,28%
Últimos 48 meses	29,82%	35,91%	-6,09%
Últimos 60 meses	46,37%	54,63%	-8,27%
Desde o início	218,56%	265,36%	-46,80%

Composição da Carteira*

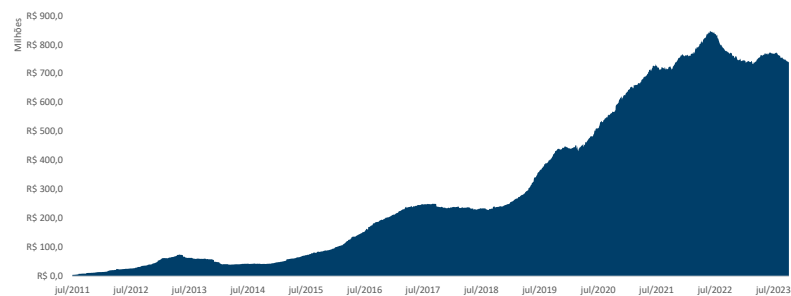
Duration: Fundo: 2,34 IMA-B5: 2,30



Data da carteira: out/2023

*Número de aberturas consecutivas: 5

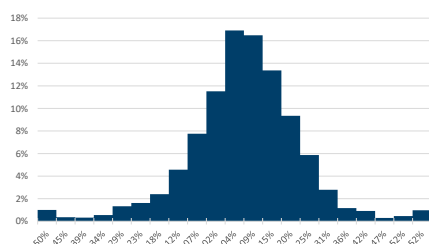
Evolução do Patrimônio Líquido



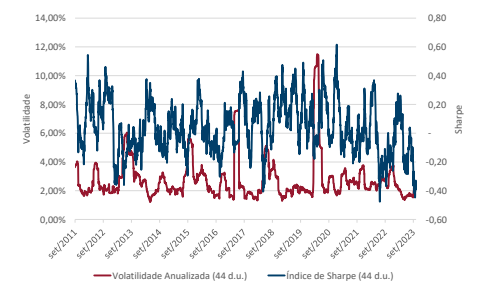
Patrimônio Líquido

	Atual	R\$	738.604.116,54
Médio nos últimos 12 meses		R\$	754.122.773,50
Médio desde o início		R\$	309.360.126,24

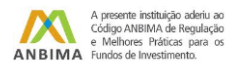
Histograma dos Retornos Diários



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 à 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 se alcançar 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 de 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)