

CNPJ
35.807.793/0001-30

Nome do fundo
JGP AÇÕES ESG 100 PREVIDENCIÁRIO ICATU SEGUROS FIC EM COTAS DE FIA EM AÇÕES IS

Gestor
JGP GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administrador
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.

Custodiante
BNY MELLON BANCO S.A.

Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

Informações do fundo
Classificação Anbima: Previdência Ações Ativo
Classificação CVM: Fundo de Ações
Código Anbima: S49010
Código ISIN: BR04JOCF003
Lançamento: 21/08/2020
Benchmark: IBOV
Cota Fechamento
Aplicações (Dias úteis): Depósito em D+0
Cota em D+2
Resgate (Dias úteis): Liquidação em D+4
Pagamento de acordo com o prazo dos planos*
Taxa de administração: Mínima: 1,85%
Máxima: 2,20%
Efetiva: 2,01%
Mínima: 0,00%
Taxa de performance: Máxima: 20% do que excede 100% do Ibovespa
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
A política de investimento do FUNDO consiste em aplicar, no mínimo, 95% de seu patrimônio líquido em cotas do JGP PREVIDENCIÁRIO ESG ICATU MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES, inscrito no CNPJ/MF sob o número 35.806.221/0001-36 ("Fundo Master").

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 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 (CVM 539/13) e posteriores alterações.

Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

| | jan | fev | mar | abr | mai | jun | jul | ago | set | out | nov | dez | Ano | Acum. |
|-----------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|---------|
| 2020 | | | | | | | | | | | | | | |
| Benchmark | | | | | | | | -0,44% | -2,88% | -0,99% | 8,81% | 5,02% | 9,41% | 9,41% |
| Dif. | | | | | | | | -2,12% | -4,88% | -0,69% | 15,90% | 9,30% | 17,23% | 17,23% |
| Fundo | 0,20% | -0,09% | -1,51% | 2,08% | 3,43% | 3,05% | -2,19% | -1,23% | -4,83% | -10,28% | -3,04% | 1,98% | -12,50% | -4,27% |
| 2021 | | | | | | | | | | | | | | |
| Benchmark | | | | | | | | -3,94% | -2,48% | -6,74% | -1,53% | 2,85% | -11,93% | -3,25% |
| Dif. | | | | | | | | -3,94% | -2,48% | -6,74% | -1,53% | 2,85% | -11,93% | -3,25% |
| Fundo | 1,23% | -4,28% | 5,59% | -9,74% | -1,41% | -11,09% | 8,97% | 6,57% | 0,93% | 7,92% | -5,45% | -4,01% | -7,07% | -11,05% |
| 2022 | | | | | | | | | | | | | | |
| Benchmark | | | | | | | | 4,69% | 6,16% | 5,45% | -3,06% | -2,45% | 4,69% | 8,09% |
| Dif. | | | | | | | | 4,69% | 6,16% | 5,45% | -3,06% | -2,45% | 4,69% | 8,09% |
| Fundo | -5,76% | -5,17% | -0,47% | 0,36% | -4,63% | 0,42% | 4,28% | 0,40% | 0,46% | 2,46% | -2,39% | -1,66% | -11,76% | -19,14% |
| 2023 | | | | | | | | | | | | | | |
| Benchmark | | | | | | | | 9,85% | 2,56% | -3,94% | 14,87% | 3,38% | 22,24% | 8,73% |
| Dif. | | | | | | | | 9,85% | 2,56% | -3,94% | 14,87% | 3,38% | 22,24% | 8,73% |
| Fundo | 3,64% | -3,57% | -3,50% | 0,09% | 5,65% | 0,09% | 5,65% | 0,09% | 0,09% | -6,97% | 14,87% | 3,38% | 22,24% | 8,73% |
| 2024 | | | | | | | | | | | | | | |
| Benchmark | | | | | | | | | | | | | -12,33% | -4,67% |
| Dif. | | | | | | | | | | | | | -12,33% | -4,67% |
| Fundo | -3,90% | -0,10% | 1,52% | -7,97% | -2,26% | 0,84% | -0,71% | 1,14% | -0,46% | -4,03% | 2,33% | | -9,01% | 20,27% |
| Benchmark | -4,79% | 0,99% | -0,71% | -1,70% | -3,04% | | | | | | | | -3,32% | -24,94% |
| Dif. | 0,89% | -1,09% | 2,23% | -6,27% | 0,78% | | | | | | | | | |

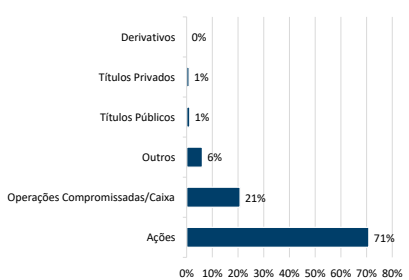
Indicadores Risco x Retorno

| Indicador | 12 meses | Desde o início |
|----------------------------|----------|----------------|
| Nº Meses <0 | 6 | 23 |
| Nº Meses =0 | 6 | 22 |
| Nº Meses >Benchmark | 6 | 22 |
| Nº Meses >Benchmark | 6 | 23 |
| Maior Rentabilidade Mensal | 14,87% | 14,87% |
| Menor Rentabilidade Mensal | -7,97% | -11,09% |
| Maximum Drawdown | 24,45% | 36,06% |
| Volatilidade Anualizada | 15,85% | 19,44% |
| Índice de Sharpe | -0,44 | -1,17 |

Rentabilidades Acumuladas

| Período | Fundo | Benchmark | Dif. |
|------------------|---------|-----------|---------|
| Últimos 3 meses | -8,68% | -5,37% | -3,31% |
| Últimos 6 meses | -9,36% | -4,11% | -5,25% |
| Últimos 12 meses | 5,08% | 12,70% | -7,62% |
| Últimos 24 meses | 9,39% | 9,65% | -0,26% |
| Últimos 36 meses | -16,30% | -3,26% | -13,04% |
| Últimos 48 meses | | | |
| Últimos 60 meses | | | |
| Desde o início | -4,67% | 20,27% | -24,94% |

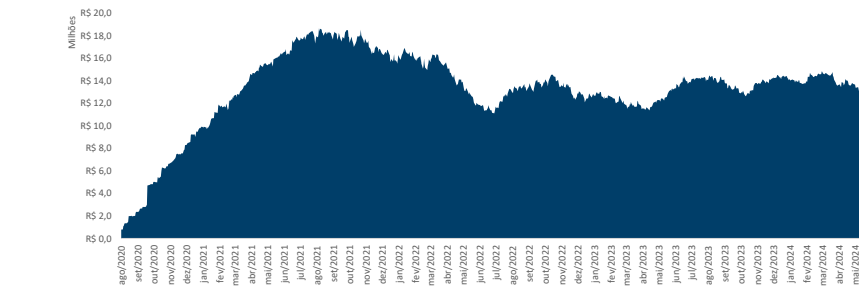
Composição da Carteira*



Data da carteira: mai/2024

*Número de aberturas consecutivas: 5

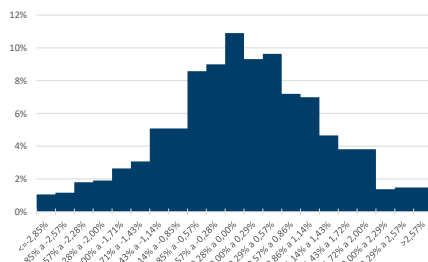
Evolução do Patrimônio Líquido



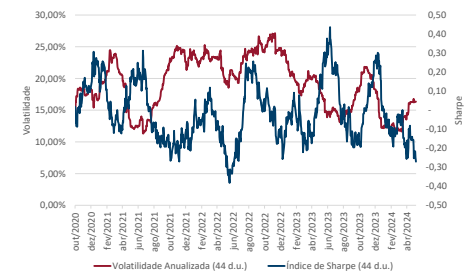
Patrimônio Líquido

| | | |
|----------------------------|-----|---------------|
| Atual | R\$ | 12.903.846,96 |
| Médio nos últimos 12 meses | R\$ | 13.890.926,87 |
| Médio desde o início | R\$ | 13.282.935,05 |

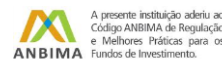
Histograma dos Retornos Diários



Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe*



*Índice calculado a partir da razão entre a média do retorno diário acima do câ 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 de 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 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)