

CNPJ
40.386.490/0001-20

Nome do fundo
SPX PREV LONG BIAS ICATU QUALIFICADO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIM

Gestor
SPX GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administrador
INTRAG DTVM LTDA.

Custodiante
ITAU UNIBANCO S.A.

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

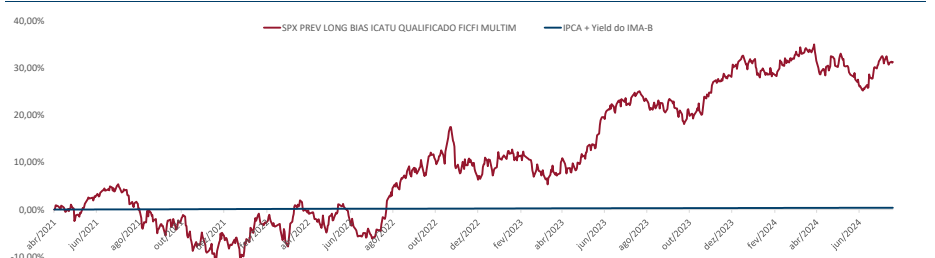
Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência Multimercado Livre
Classificação CVM Fundo Multimercado
Código Anbima 595446
Código ISIN BR076FCTF001
Lançamento 13/04/2021
Benchmark IPCA + Yield do IMA-B
Cota Fechamento
Aplicações (Dias úteis) Depósito em D+0
Cota em D+0
Resgate (Dias úteis) Cota em D+30
Liquidação em D+32
Pagamento de acordo com o prazo dos planos*
Mínima: 0,70%
Taxa de administração Máxima: 2,00%
Efetiva: 2,00%
Mínima: 0,00%
Taxa de performance Máxima: Não há, mas poderá comprar cotas de fundos de investimento que possuem de taxa de performance Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O FUNDO direcionará, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seu patrimônio em cotas do fundo SPX LONG BIAS PREVIDENCIÁRIO MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO, cujo objetivo de investimentos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica.

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 (ICVM 539/13) e posteriores alterações.

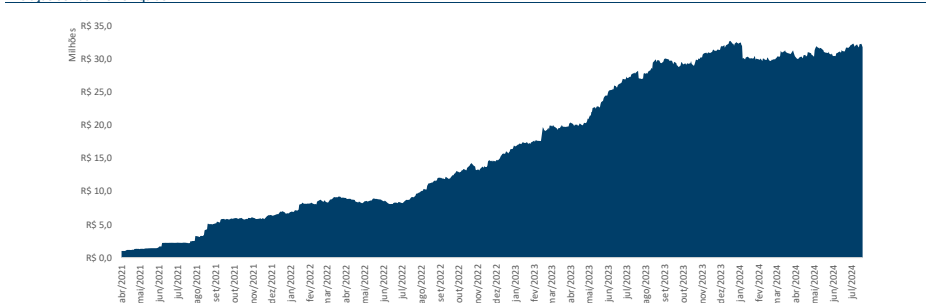
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2020	Fundo														
	Benchmark														
	Dif.														
2021	Fundo														
	Benchmark														
	Dif.														
2022	Fundo	5,14%	-2,48%	4,55%	-3,57%	3,56%	-6,08%	4,05%	8,36%	1,67%	6,27%	-3,80%	-0,26%	17,52%	10,54%
	Benchmark	0,01%	0,01%	0,02%	0,01%	0,01%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,01%	0,01%	0,12%	0,22%
	Dif.	5,13%	-2,50%	4,53%	-3,58%	3,55%	-6,09%	4,05%	8,36%	1,67%	6,26%	-3,81%	-0,27%	17,40%	10,32%
2023	Fundo	1,38%	-2,66%	-1,54%	1,63%	3,01%	8,18%	2,10%	-2,80%	-0,35%	-0,65%	6,51%	3,57%	19,95%	30,59%
	Benchmark	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,00%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,10%	0,33%
	Dif.	1,97%	-2,68%	-1,56%	1,62%	3,00%	8,18%	2,09%	-2,81%	-0,36%	-0,66%	6,51%	3,56%	19,85%	32,27%
2024	Fundo	-2,80%	1,65%	2,45%	-3,55%	-0,69%	-0,43%	2,54%						-1,01%	31,25%
	Benchmark	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%						0,06%	0,38%
	Dif.	-2,81%	1,64%	2,44%	-3,56%	-0,70%	-0,44%	2,53%						-1,07%	30,87%

Evolução do Patrimônio Líquido



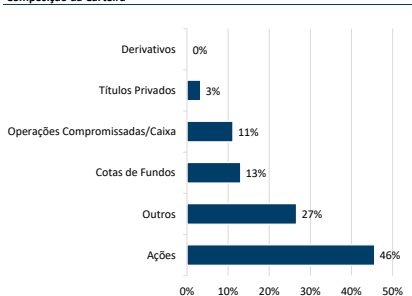
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	7	19
Nº Meses >0	5	20
Nº Meses <Benchmark	7	19
Nº Meses >Benchmark	5	20
Maior Rentabilidade Mensal	6,51%	8,36%
Menor Rentabilidade Mensal	-3,55%	-6,08%
Maximum Drawdown	7,24%	16,43%
Volatilidade Anualizada	9,69%	12,86%
Índice de Sharpe	-0,66	-0,38

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	Dif.
Últimos 3 meses	1,40%	0,02%	1,37%
Últimos 6 meses	1,84%	0,05%	1,79%
Últimos 12 meses	5,08%	0,10%	4,98%
Últimos 24 meses	33,40%	0,20%	33,20%
Últimos 36 meses	29,81%	0,35%	29,47%
Últimos 48 meses			
Últimos 60 meses			
Desde o início	31,25%	0,38%	30,87%

Composição da Carteira*

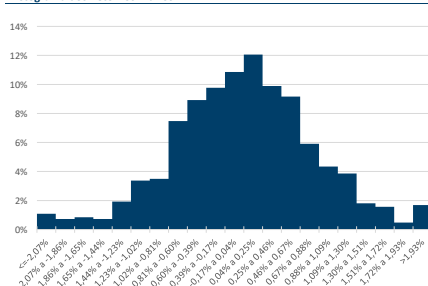


Data da carteira: jul/2024
*Número de aberturas consecutivas: 5

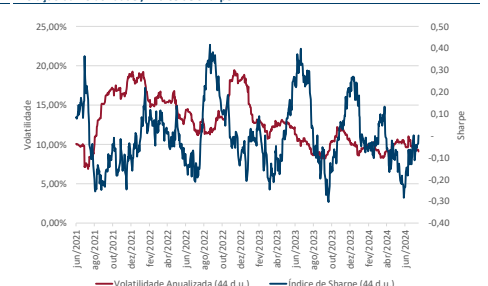
Patrimônio Líquido

	Atual	R\$	31.756.722,00
Médio nos últimos 12 meses		R\$	30.461.165,18
Médio desde o início		R\$	16.841.475,98

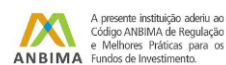
Histograma dos Retornos Diários



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 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 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)