

Material de Divulgação do Fundo

CNPJ
21.494.444/0001-09

Nome do fundo
ICATU VANGUARDA ABSOLUTO FUNDO DE INVESTIMENTO PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA CRED PRIV

Gestor
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administrador
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.

Custodiante
BANCO BRADESCO S.A.

Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

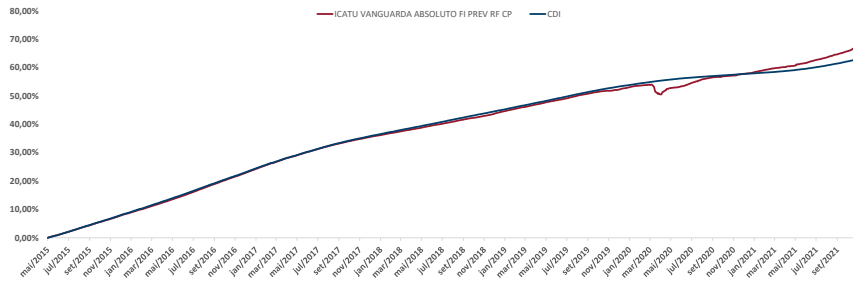
Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência RF Duração Livre Crédito Liv
Classificação CVM Fundo de Renda Fixa
Código Anbima 396389
Código ISIN BR1852CTF009
Lançamento 12/05/2015
Benchmark CDI (%)
Cota Fechamento
Depósito em D+0
Cota em D+0
Resgate (Dias Úteis) Liquidação em D+5
Pagamento de acordo com o prazo dos planos*
Mínima: 0,45%
Taxa de administração Máxima: 0,80%
Efetiva: 0,79%
Mínima: 0,00%
Taxa de performance Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O FUNDO tem por objetivo superar as taxas diárias de remuneração de certificados de depósito interfinanceiro - CDI, para isso buscará retorno aos seus Cotistas através de investimentos em ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, derivativos e cotas de fundos de investimento de Renda Fixa conforme definição da IN CVM 555, negociados no mercado interno, sendo vedada exposição à renda variável, cambial e alavancagem.

Público Alvo

O FUNDO destina-se exclusivamente a receber, diretamente ou por meio dos seus fundos de investimentos, recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre - PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre - VGBL instituídos pela Icatu Seguros S.A. Investidor Profissional nos termos da Instrução CVM nº 539, de 13 de novembro de 2013 ("ICVM 539/13") e posteriores alterações.

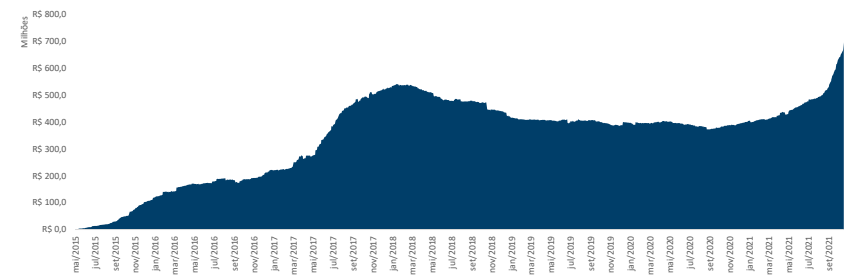
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	ma	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2017	Fundo	1,12%	0,87%	1,09%	0,81%	0,92%	0,81%	0,79%	0,76%	0,61%	0,62%	0,53%	0,51%	9,85%	35,95%
	Benchmark %CDI	1,08%	0,86%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	0,80%	0,80%	0,64%	0,64%	0,57%	0,54%	9,93%	36,27%
2018	Fundo	0,53%	0,42%	0,50%	0,45%	0,53%	0,48%	0,49%	0,55%	0,46%	0,46%	0,44%	0,49%	6,18%	44,35%
	Benchmark %CDI	0,58%	0,46%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	45,02%
2019	Fundo	0,58%	0,52%	0,47%	0,53%	0,55%	0,42%	0,59%	0,54%	0,47%	0,47%	0,32%	0,23%	0,46%	5,84%
	Benchmark %CDI	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%	
2020	Fundo	107,56%	104,64%	99,98%	103,03%	101,15%	89,76%	104,49%	108,47%	100,74%	67,71%	60,42%	122,92%	98,04%	98,37%
	Benchmark %CDI	0,51%	0,17%	-1,72%	0,84%	0,36%	0,66%	0,88%	0,58%	0,30%	0,22%	0,31%	0,33%	3,47%	
2021	Fundo	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,76%	57,90%
	Benchmark %CDI	136,44%	57,60%	-507,22%	295,94%	152,85%	311,14%	452,91%	360,07%	187,95%	141,63%	209,85%	198,04%	125,92%	100,34%
	Fundo	0,47%	0,43%	0,37%	0,29%	0,51%	0,58%	0,56%	0,69%	0,61%	0,83%	0,83%	0,83%	5,45%	66,71%
	Benchmark %CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%			3,02%	62,67%
	Fundo	311,54%	317,33%	182,24%	137,80%	190,34%	188,51%	157,17%	160,07%	138,37%	169,92%			180,32%	106,44%
	Benchmark %CDI														

Evolução do Patrimônio Líquido



Patrimônio Líquido

	Atual	R\$	694.109.695,18
Médio nos últimos 12 meses	R\$	457.084.101,62	
Médio desde o início	R\$	345.330.371,58	

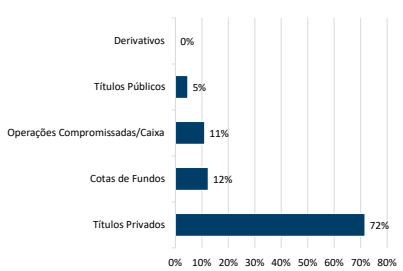
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	0	1
Nº Meses >0	12	76
Nº Meses <Benchmark	0	31
Nº Meses >Benchmark	12	46
Maior Rentabilidade Mensal	0,83%	1,26%
Menor Rentabilidade Mensal	0,29%	-1,72%
Maximum Drawdown	0,05%	2,27%
Volatilidade Anualizada	0,34%	0,45%
Índice de Sharpe	8,30	3,50

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	2,14%	1,36%	156,92%
Últimos 6 meses	3,84%	2,31%	165,94%
Últimos 12 meses	6,12%	3,35%	183,06%
Últimos 24 meses	9,87%	6,66%	148,05%
Últimos 36 meses	16,82%	13,28%	126,63%
Últimos 48 meses	23,90%	20,70%	115,46%
Últimos 60 meses	37,67%	34,07%	110,56%
Desde o início	66,71%	62,67%	106,44%

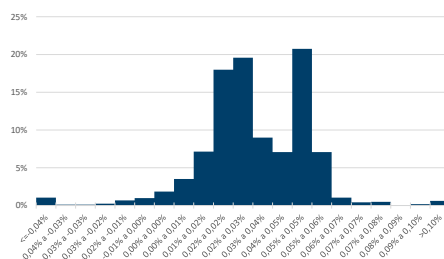
Composição da Carteira***



Data da carteira: Jul/2021

***Número de aberturas consecutivas: 5

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 do Fundo ou pelo 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)