

CNPJ
27.239.065/0001-40

Nome do fundo
CAPITÂNIA MULTIPREV ICATU FI EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO

Gestor
CAPITÂNIA S/A

Administrador
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.

Custodiante
BNY MELLON BANCO S.A.

Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES

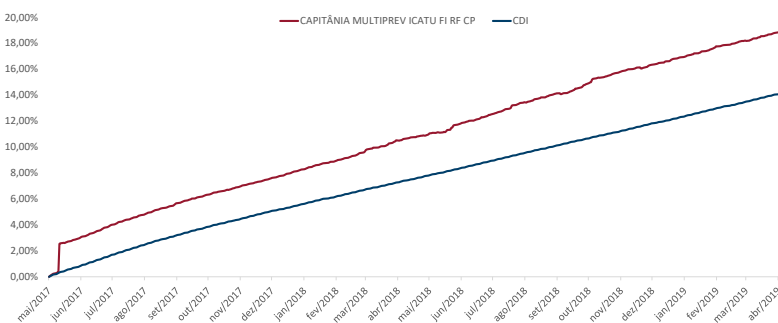
Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência Renda Fixa
Classificação CVM Fundo de Renda Fixa
Código Anbima 441104
Código ISIN BRCM3ICTF002
Lançamento 22/05/2017
Benchmark CDI
Cota Fechamento
Depósito em D+0
Aplicações Cota em D+0
Cota em D+1
Resgate Liquidação em D+4
Pagamento em até D+10 (prazo dos planos)**
Taxa de administração Mínima: 0,50%
Máxima: 1,25%
Efetiva: 1,25%
Taxa de performance Mínima: 0,00%
Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
A política de investimento do FUNDO consiste em utilizar perfil não referenciado em indicador de desempenho em função da estrutura dos ativos financeiros e/ou modalidades operacionais integrantes da carteira, visando atingir rentabilidade superior às taxas diárias de remuneração de certificados de depósito interfinanceiro - CDI, tendo como principal fator de risco a variação da taxa de juros domésticas e/ou índices de preços. O FUNDO poderá aplicar os recursos integrantes de sua carteira em quaisquer ativos financeiros permitidos pela legislação aplicável, devendo-se observar, contudo, os limites de concentração e os riscos previstos neste Regulamento.

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.

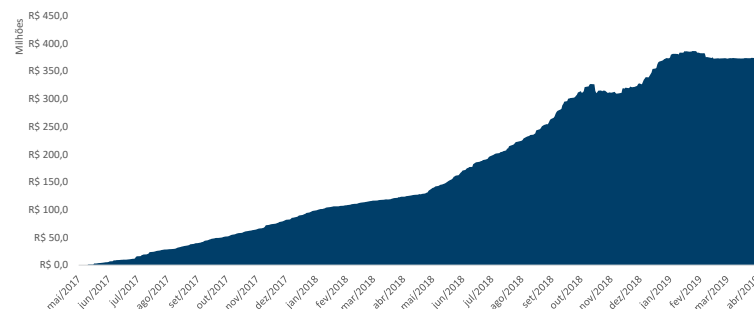
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.	
2015	Fundo															
	Benchmark %CDI															
2016	Fundo															
	Benchmark %CDI															
2017	Fundo						0,39%	2,91%	0,91%	0,81%	0,72%	0,65%	0,58%	0,56%	7,76%	7,76%
	Benchmark %CDI						0,29%	0,81%	0,80%	0,80%	0,64%	0,64%	0,57%	0,54%	5,20%	5,20%
2018	Fundo	0,72%	0,51%	0,79%	0,64%	0,44%	0,79%	0,69%	0,80%	0,41%	1,05%	0,55%	0,44%	8,11%	16,51%	
	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%	11,96%	
2019	Fundo	0,61%	0,54%	0,44%	0,57%									2,18%	19,04%	
	Benchmark %CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%									2,04%	14,24%	
		112,62%	109,49%	93,18%	110,42%									106,84%	133,75%	

Evolução do Patrimônio Líquido



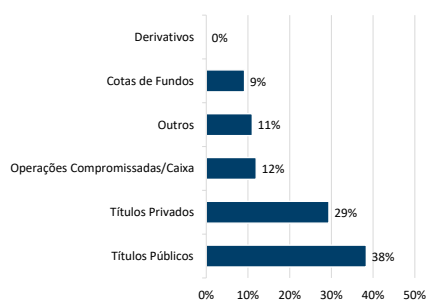
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	0	0
Nº Meses >0	12	23
Nº Meses <Benchmark	4	4
Nº Meses >Benchmark	8	19
Maior Rentabilidade Mensal	1,05%	2,91%
Menor Rentabilidade Mensal	0,41%	0,41%
Maximum Drawdown	0,08%	0,08%
Volatilidade Anualizada	0,44%	1,57%
Índice de Sharpe	2,79	2,20

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	1,56%	1,49%	104,67%
Últimos 6 meses	3,20%	3,05%	105,03%
Últimos 12 meses	7,58%	6,34%	119,54%
Últimos 24 meses			
Últimos 36 meses			
Últimos 48 meses			
Últimos 60 meses			
Desde o início	19,04%	14,24%	133,75%

Composição da Carteira*

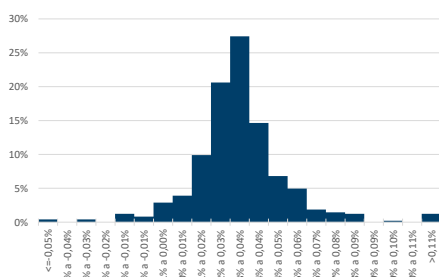


Data da carteira: abr/2019
*Número de aberturas consecutivas: 5

Patrimônio Líquido

Atual	R\$	372.018.389,90
Médio nos últimos 12 meses	R\$	281.853.546,66
Médio desde o início	R\$	174.940.581,98

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 aprovados a partir de 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é de até 10 (dez) dias úteis 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 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)