

CNPJ
25.098.148/0001-31

Nome do fundo
DLM ICATU SEG PREVIDÊNCIA FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO

Gestor
DLM INVISTA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Administrador
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.

Custodiante
BANCO BRADESCO S.A.

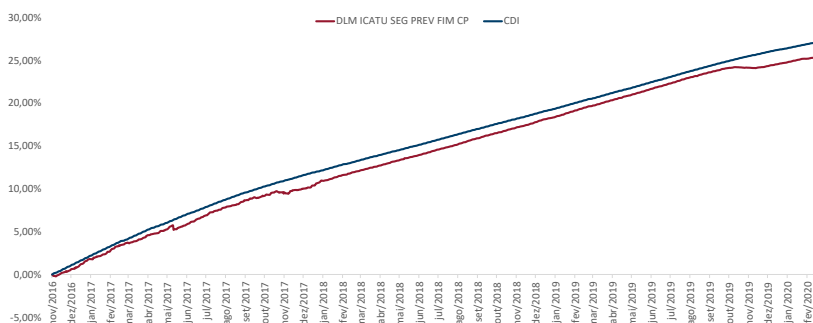
Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES

Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência Multimercado Livre
Classificação CVM Fundo Multimercado
Código Anbima 428159
Código ISIN BR11CTCF002
Lançamento 08/11/2016
Benchmark CDI
Cota Fechamento Depósito em D+0
Aplicações Cota em D+0
Cota em D+1
Resgate Liquidação em D+3
Pagamento em até D+10 (prazo dos planos)**
Taxa de administração Mínima: 0,80%
Máxima: 0,80%
Efetiva: 0,80%
Taxa de performance Mínima: 0,00%
Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O objetivo do FUNDO é buscar proporcionar ao COTISTA rentabilidade através de aplicação de recursos em carteira diversificada de títulos, valores mobiliários, ativos financeiros e modalidades operacionais disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, sem o compromisso de concentração em nenhum fator de risco em especial, subordinando-se aos requisitos de composição e diversificação estabelecidos neste regulamento e na regulamentação em vigor aplicável ao FUNDO

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.

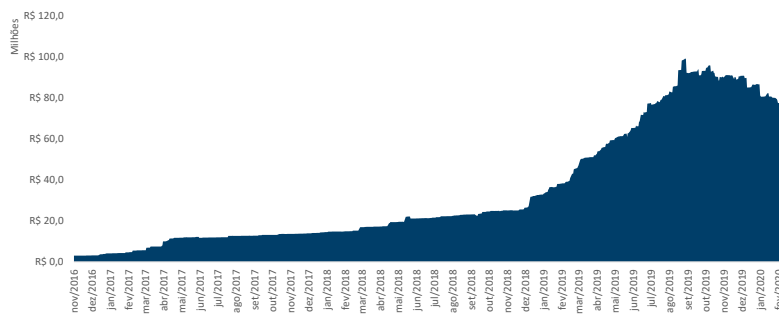
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.	
2016	Fundo													0,39%	1,15%	1,54%
	Benchmark %CDI													0,78%	1,12%	1,91%
2017	Fundo	0,85%	1,01%	0,81%	0,77%	0,49%	1,02%	0,84%	0,77%	0,52%	0,53%	0,28%	0,73%	8,97%	10,65%	
	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%	12,02%	
2018	Fundo	0,70%	0,51%	0,51%	0,56%	0,52%	0,55%	0,54%	0,64%	0,50%	0,57%	0,51%	0,56%	6,88%	18,26%	
	Benchmark %CDI	0,58%	0,46%	0,53%	0,52%	0,52%	0,54%	0,54%	0,47%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%	19,22%	
2019	Fundo	120,76%	110,41%	95,52%	107,69%	100,91%	106,67%	98,82%	113,67%	106,02%	105,20%	102,59%	113,77%	107,15%	95,04%	
	Benchmark %CDI	0,58%	0,54%	0,49%	0,54%	0,56%	0,50%	0,61%	0,49%	0,46%	0,11%	0,05%	0,37%	5,43%	24,69%	
2020	Fundo	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%	25,42%	
	Benchmark %CDI	107,61%	110,42%	103,89%	104,39%	102,56%	105,85%	107,74%	97,42%	98,31%	22,65%	13,78%	99,77%	91,12%	93,79%	
	Fundo	0,40%	0,19%											0,59%	25,42%	
	Benchmark %CDI	0,38%	0,29%											0,67%	27,17%	
	Fundo	106,07%	63,61%											87,43%	93,56%	

Evolução do Patrimônio Líquido



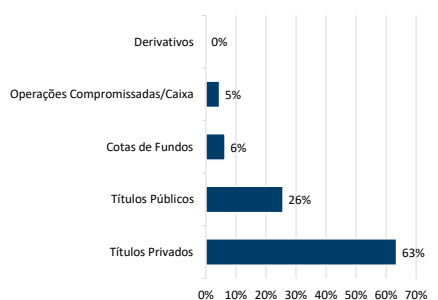
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	0	0
Nº Meses >0	12	39
Nº Meses <Benchmark	6	16
Nº Meses >Benchmark	6	23
Maior Rentabilidade Mensal	0,61%	1,15%
Menor Rentabilidade Mensal	0,05%	0,05%
Maximum Drawdown	0,10%	0,51%
Volatilidade Anualizada	0,17%	0,55%
Índice de Sharpe	-4,35	-1,81

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	0,96%	1,05%	91,84%
Últimos 6 meses	1,59%	2,39%	66,34%
Últimos 12 meses	4,86%	5,77%	87,22%
Últimos 24 meses	11,98%	12,34%	97,07%
Últimos 36 meses	21,24%	22,39%	94,87%
Últimos 48 meses			
Últimos 60 meses			
Desde o início	25,42%	27,17%	93,56%

Composição da Carteira*

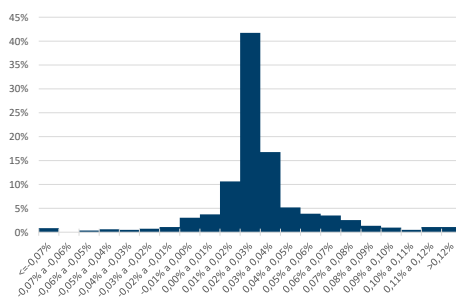


Data da carteira: fev/2020
*Número de aberturas consecutivas: 5

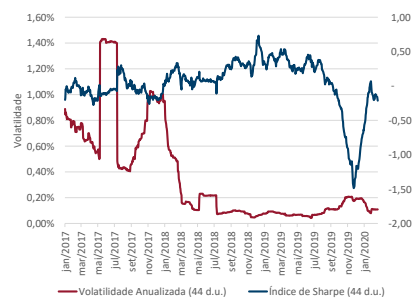
Patrimônio Líquido

Atual	R\$	76.305.741,75
Médio nos últimos 12 meses	R\$	77.200.192,47
Médio desde o início	R\$	34.942.768,42

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 da 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)