

**CNPJ**  
21.494.444/0001-09

**Nome do fundo**  
ICATU SEG 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.

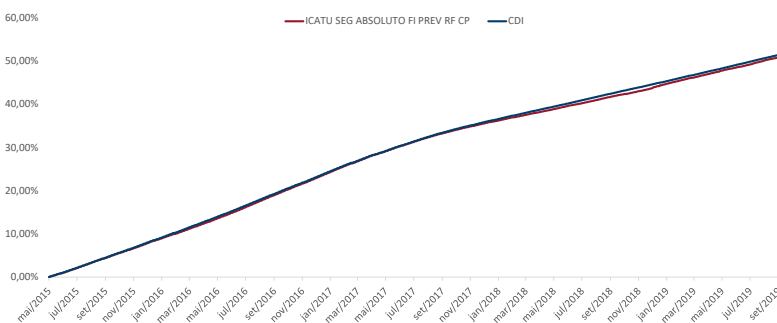
**Auditor independente**  
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES

**Informações do fundo**  
Classificação Anbima Previdência Renda Fixa  
Classificação CVM Fundo de Renda Fixa  
Código Anbima 396389  
Código ISIN BR1812CTF009  
Lançamento 12/05/2015  
Benchmark CDI  
Cota Fechamento  
Depósito em D+0  
Aplicações Cota em D+0  
Cota em D+1  
Resgate Liquidação em D+2  
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 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.

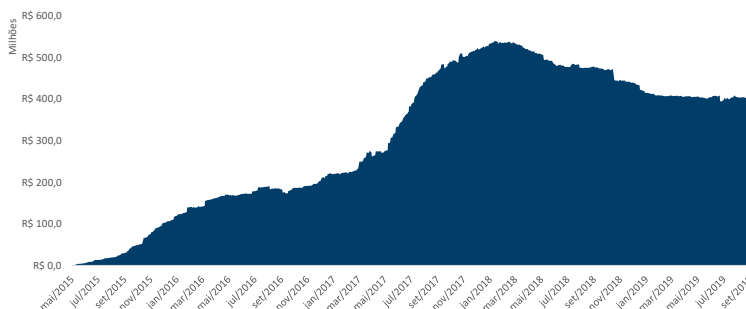
**Evolução da Rentabilidade Acumulada**



**Rentabilidades**

		jan	fev	mar	abr	maí	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2015	Fundo					0,62%	1,02%	1,19%	1,11%	1,09%	1,07%	1,02%	1,17%	8,59%	8,59%
	Benchmark %CDI					0,64%	1,07%	1,18%	1,11%	1,11%	1,11%	1,06%	1,16%	8,74%	8,74%
2016	Fundo	0,99%	0,93%	1,12%	1,02%	1,11%	1,17%	1,15%	1,26%	1,13%	1,08%	1,05%	1,14%	13,97%	23,76%
	Benchmark %CDI	1,05%	1,00%	1,16%	1,05%	1,11%	1,16%	1,11%	1,21%	1,11%	1,05%	1,04%	1,12%	14,00%	23,96%
2017	Fundo	93,57%	92,24%	96,18%	96,94%	100,38%	100,71%	104,06%	103,48%	102,17%	103,25%	100,91%	101,87%	99,80%	99,14%
	Benchmark %CDI	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%
2018	Fundo	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%
	Benchmark %CDI	103,48%	100,84%	104,13%	102,77%	99,48%	100,13%	98,82%	94,46%	96,23%	95,98%	93,32%	94,35%	99,27%	99,13%
2019	Fundo	0,53%	0,42%	0,50%	0,45%	0,53%	0,48%	0,49%	0,55%	0,46%	0,44%	0,49%	0,66%	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	90,74%	90,91%	93,74%	87,40%	102,46%	92,69%	89,89%	97,83%	98,37%	81,91%	99,53%	133,67%	96,23%	98,52%
	Benchmark %CDI	0,58%	0,52%	0,47%	0,53%	0,55%	0,42%	0,59%	0,54%	0,47%				4,78%	51,25%
2019	Fundo	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%				4,66%	51,78%
	Benchmark %CDI	107,56%	104,64%	99,98%	103,03%	101,15%	89,76%	104,49%	108,47%	100,74%				102,44%	98,97%

**Evolução do Patrimônio Líquido**



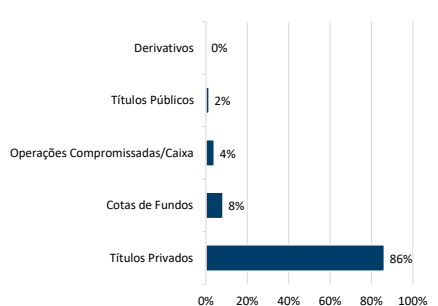
**Indicadores Risco x Retorno**

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	0	0
Nº Meses >0	12	52
Nº Meses <Benchmark	4	27
Nº Meses >Benchmark	8	25
Maior Rentabilidade Mensal	0,66%	1,26%
Menor Rentabilidade Mensal	0,42%	0,42%
Maximum Drawdown	0,03%	0,03%
Volatilidade Anualizada	0,17%	0,23%
Índice de Sharpe	1,04	-1,21

**Rentabilidades Acumuladas**

Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	1,61%	1,54%	104,68%
Últimos 6 meses	3,15%	3,10%	101,50%
Últimos 12 meses	6,46%	6,27%	102,95%
Últimos 24 meses	13,10%	13,34%	98,19%
Últimos 36 meses	26,25%	26,41%	99,42%
Últimos 48 meses	43,87%	44,27%	99,10%
Últimos 60 meses			
Desde o início	51,25%	51,78%	98,97%

**Composição da Carteira\***

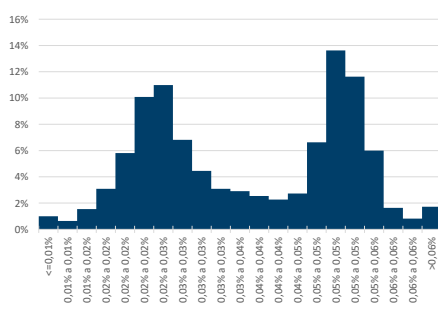


Data da carteira: set/2019  
\*Número de aberturas consecutivas: 5

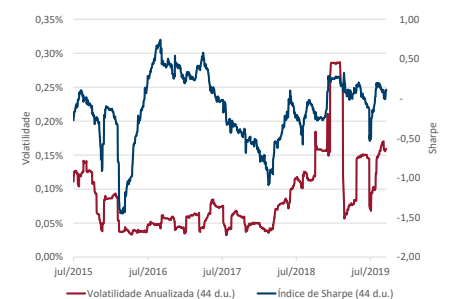
**Patrimônio Líquido**

Atual	R\$	400.469.882,19
Médio nos últimos 12 meses	R\$	416.788.972,12
Médio desde o início	R\$	308.818.705,13

**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 de 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 a 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](http://www.cvm.gov.br/))