

CNPJ
12.823.627/0001-21

Nome do fundo
ICATU SEG FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA INFLAÇÃO CURTA

Gestor
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administrador
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.

Custodiante
BANCO BRADESCO S.A.

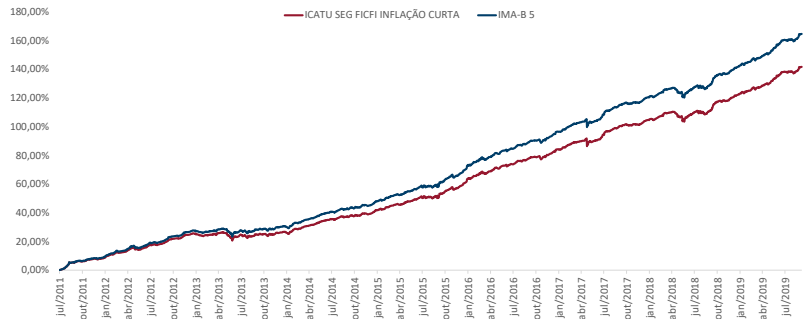
Auditor independente
PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES

Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência Renda Fixa
Classificação CVM Fundo de Renda Fixa
Código Anbima 282499
Código ISIN BRSE62CF008
Lançamento 25/07/2011
Benchmark IMA-B 5
Cota Fechamento
Aplicações Depósito em D+0
Cota em D+0
Resgate Liquidação em D+1
Pagamento em até D+10 (prazo dos planos)**
Taxa de administração Mínima: 1,00%
Máxima: 1,00%
Efetiva: 1,00%
Taxa de performance Mínima: 0,00%
Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O FUNDO tem por objetivo acompanhar ou superar a rentabilidade do IMA-B 5, divulgado pela ANDIMA, índice este que é composto por títulos públicos federais atrelados ao IPCA, com maturidade inferior a cinco anos, que estejam em poder do público, através de investimentos em cotas de fundos de investimento ou cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento de Renda Fixa conforme definição da IN CVM 555 ("FUNDOS INVESTIDOS"), negociados no mercado interno, para tanto, os "FUNDOS INVESTIDOS" poderão alocar seus investimentos em ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados no mercado interno, sendo vedada exposição à renda variável, cambial e alavancagem e desde que respeitadas as regras e os limites impostos pela legislação vigente.

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.

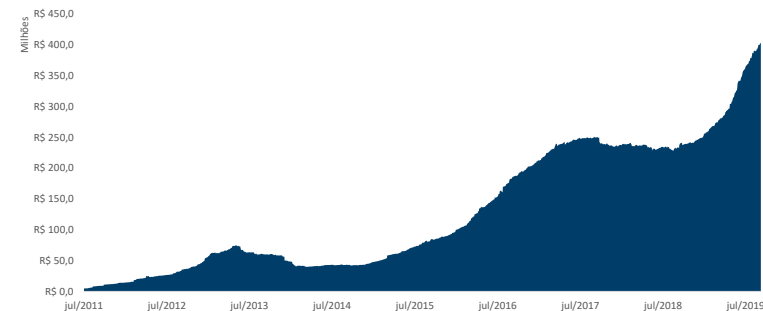
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	maí	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2015	Fundo	1,90%	1,13%	0,93%	0,37%	1,59%	0,78%	1,69%	-0,58%	0,64%	2,39%	0,42%	1,99%	14,02%	59,05%
	Benchmark	2,05%	1,22%	1,03%	0,46%	1,63%	0,85%	1,78%	-0,47%	0,79%	2,49%	0,55%	2,12%	15,46%	67,91%
	Dif.	-0,16%	-0,09%	-0,10%	-0,09%	-0,04%	-0,07%	-0,09%	-0,11%	-0,15%	-0,10%	-0,13%	-0,13%	-1,44%	-8,86%
2016	Fundo	2,83%	1,42%	0,72%	1,48%	0,73%	0,81%	1,13%	1,00%	1,33%	0,41%	0,32%	1,30%	14,33%	81,85%
	Benchmark	2,97%	1,54%	0,76%	1,54%	0,80%	0,94%	1,21%	1,09%	1,41%	0,46%	0,40%	1,39%	15,48%	93,91%
	Dif.	-0,14%	-0,12%	-0,03%	-0,06%	-0,06%	-0,13%	-0,07%	-0,09%	-0,08%	-0,04%	-0,08%	-0,09%	-1,15%	-12,07%
2017	Fundo	1,07%	1,49%	1,31%	0,53%	0,42%	2,82%	1,19%	0,95%	0,38%	0,02%	0,82%	1,15%	102,80%	118,30%
	Benchmark	1,16%	1,49%	1,39%	0,71%	0,08%	0,52%	2,85%	1,23%	1,01%	0,48%	0,10%	0,88%	12,58%	118,30%
	Dif.	-0,09%	-0,01%	-0,08%	-0,18%	-0,09%	-0,10%	-0,03%	-0,07%	-0,06%	-0,10%	-0,08%	-0,07%	-1,06%	-15,50%
2018	Fundo	1,24%	0,48%	1,58%	0,34%	-1,72%	0,34%	1,38%	-0,33%	0,78%	3,07%	0,07%	1,28%	8,78%	120,60%
	Benchmark	1,33%	0,54%	1,62%	0,42%	-1,56%	0,45%	1,48%	-0,26%	0,89%	3,10%	0,14%	1,36%	9,87%	139,84%
	Dif.	-0,10%	-0,06%	-0,04%	-0,08%	-0,17%	-0,11%	-0,10%	-0,07%	-0,10%	-0,02%	-0,07%	-0,08%	-1,08%	-19,23%
2019	Fundo	1,47%	0,45%	0,70%	1,01%	1,32%	1,67%	0,86%	-0,05%	1,68%	0,94%	0,94%	1,41%	9,49%	141,54%
	Benchmark	1,54%	0,55%	0,78%	1,11%	1,39%	1,72%	0,97%	0,05%	1,74%	1,07%	1,07%	1,41%	10,27%	164,46%
	Dif.	-0,07%	-0,09%	-0,08%	-0,09%	-0,06%	-0,04%	-0,11%	-0,10%	-0,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,78%	-22,93%

Evolução do Patrimônio Líquido



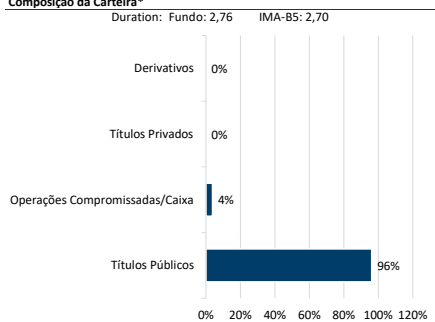
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	1	13
Nº Meses >0	11	85
Nº Meses <Benchmark	12	98
Nº Meses >Benchmark	0	0
Mayor Rentabilidade Mensal	3,07%	3,85%
Menor Rentabilidade Mensal	-0,05%	-1,72%
Maximum Drawdown	0,75%	4,66%
Volatilidade Anualizada	2,17%	2,97%
Índice de Sharpe	3,73	3,08

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	Dif.
Últimos 3 meses	2,51%	2,78%	-0,28%
Últimos 6 meses	6,67%	7,17%	-0,50%
Últimos 12 meses	14,39%	15,40%	-1,01%
Últimos 24 meses	20,57%	22,93%	-2,37%
Últimos 36 meses	35,54%	39,47%	-3,94%
Últimos 48 meses	59,23%	65,74%	-6,51%
Últimos 60 meses	76,18%	85,54%	-9,36%
Desde o início	141,54%	164,46%	-22,93%

Composição da Carteira*

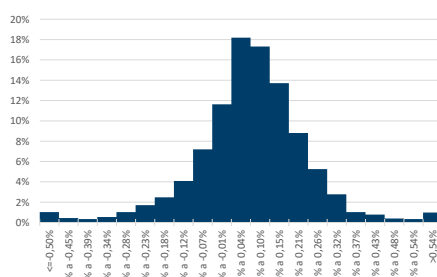


Data da carteira: set/2019
*Número de aberturas consecutivas: 5

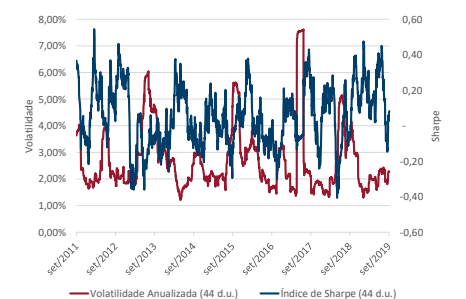
Patrimônio Líquido

	Atual	RS
Méio nos últimos 12 meses	RS	402.067.097,12
Méio desde o início	RS	296.994.394,80
	RS	129.932.028,30

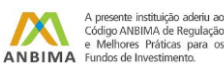
Histograma dos Retornos Diários



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 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)