

Informações Gerais

| | |
|---------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Público Alvo | Investidores em geral |
| Classificação ANBIMA | RF Duração Alta Grau de Inv. |
| CNPJ | 19.418.031/0001-95 |
| Código ANBIMA | 366153 |
| Gestor | Icatu Vanguarda Gestão de Recursos |
| Administrador | BEM DTVM |
| Custodiante | Banco Bradesco S/A |
| Auditor Independente | Deloitte |
| Lançamento | 11/04/2014 |
| Benchmark | IRF-M 1+ |
| PL Atual | R\$ 511.821.616 |
| PL Médio (12m) | R\$ 463.019.561 |
| Taxa de Administração | 0,300% a.a. |
| Taxa de Performance | 20% s/ 100% do IRF-M 1+ |
| Tipo de Cota | Fechamento |
| Aplicação Mínima Inicial | R\$ 500,00 |
| Movimentação Mínima | R\$ 500,00 |
| Saldo Mínimo Permanência | R\$ 500,00 |
| Horário de Movimentação | Até as 14h |
| Aplicações (dias úteis) | Depósito em D+0 |
| | Cota em D+0 |
| Resgate (dias úteis) | Cota em D+0 |
| | Pagamento em D+1 |
| Tributação IR | Alíquota de 22,5% a 15%, a depender do prazo, sobre o rendimento no resgate ou 15% recolhido semestralmente nos meses de maio e novembro. |
| IOF | Alíquota regressiva sobre o rendimento de aplicações de prazo inferior a 30 dias |

Descrição

O fundo tem como objetivo estar sempre pré fixado "nominal" com uma duration próxima a 4 anos. A estratégia é implementada através da venda de DIs futuros e/ou compra de LTNs e NTNFS. O fundo destina-se àqueles clientes que querem estar pré fixados em ativos nominais e não reais, aproveitando, por exemplo, momentos de inflação implícita alta.

Tabela de Rentabilidades¹

| | 2020 | | 2019 | | 2018 | | 2017 | |
|-----------|--------|----------|--------|----------|--------|----------|--------|----------|
| | Fundo | IRF-M 1+ |
| janeiro | 1,26% | 1,11% | 2,17% | 1,71% | 2,20% | 1,55% | 3,22% | 2,66% |
| fevereiro | 0,83% | 0,80% | 0,11% | 0,23% | 1,58% | 1,31% | 2,91% | 2,37% |
| março | -1,09% | -0,47% | 0,60% | 0,63% | 1,74% | 1,57% | 1,61% | 1,63% |
| abril | 1,47% | 1,50% | 0,64% | 0,65% | 0,13% | 0,45% | 0,14% | 0,41% |
| maio | 2,38% | 1,92% | 2,79% | 2,17% | -4,21% | -2,62% | -0,54% | 0,09% |
| junho | 1,32% | 1,04% | 3,81% | 2,72% | -0,22% | -0,15% | 1,62% | 1,51% |
| julho | 2,05% | 1,47% | 1,45% | 1,27% | 2,53% | 1,79% | 3,40% | 2,76% |
| agosto | -2,09% | -1,13% | -0,24% | 0,10% | -2,84% | -1,47% | 1,05% | 1,11% |
| setembro | -2,04% | -0,91% | 2,25% | 1,87% | 1,86% | 1,57% | 1,99% | 1,73% |
| outubro | -0,37% | -0,61% | 2,76% | 2,22% | 7,52% | 4,71% | -0,67% | -0,07% |
| novembro | 0,49% | 0,46% | -1,30% | -0,83% | 1,42% | 1,17% | -0,44% | -0,08% |
| dezembro | | | 0,80% | 0,72% | 2,39% | 1,92% | 1,74% | 1,46% |

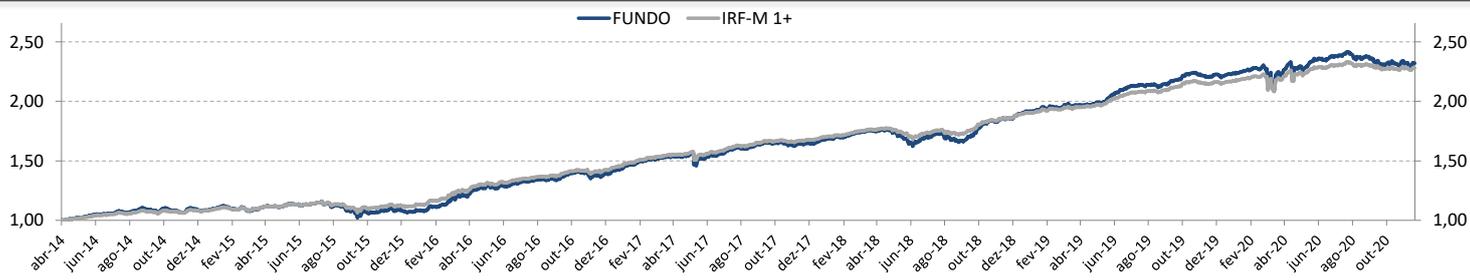
| | 2020 | | 2019 | | 2018 | | 2017 | |
|-------------|---------|----------|---------|----------|--------|----------|--------|----------|
| | Fundo | IRF-M 1+ | Fundo | IRF-M 1+ | Fundo | IRF-M 1+ | Fundo | IRF-M 1+ |
| Acum Ano | 4,16% | 5,24% | 16,91% | 14,24% | 14,52% | 12,27% | 17,15% | 16,67% |
| Acum Início | 131,67% | 127,63% | 122,41% | 116,28% | 90,24% | 89,33% | 66,11% | 68,64% |

| | 6 meses | | 12 meses | | 24 meses | | 36 meses | |
|----------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| | Fundo | IRF-M 1+ | Fundo | IRF-M 1+ | Fundo | IRF-M 1+ | Fundo | IRF-M 1+ |
| Retornos | -0,71% | 0,29% | 5,00% | 6,00% | 24,69% | 22,54% | 41,89% | 36,94% |

Nível de Risco



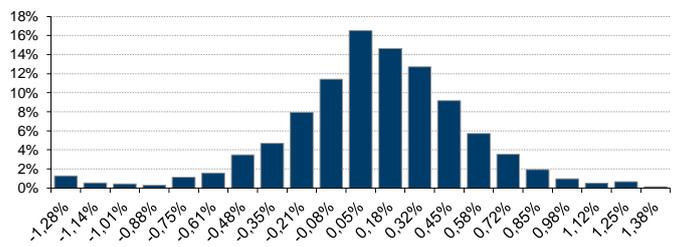
Rentabilidade Acumulada x IRF-M 1+



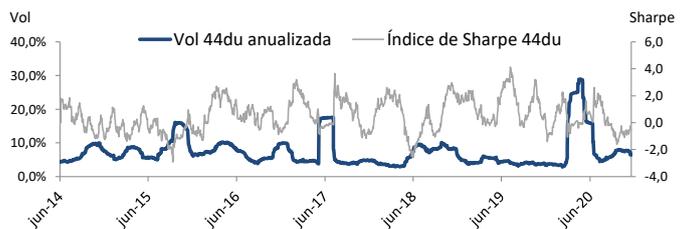
Estatísticas de 2017 a 2020

| Descrição | Estatísticas |
|--------------------------------|------------------|
| Nº Meses >0 | 35 (74%) |
| Nº Meses <0 | 12 (26%) |
| Nº Meses >Benchmark | 28 (60%) |
| Nº Meses <Benchmark | 19 (40%) |
| Mayor Rentabilidade Mensal | 7,52% - 10/2018 |
| Menor Rentabilidade Mensal | -4,21% - 05/2018 |
| Maximum Drawdown ¹ | -12,04% |
| Volatilidade Diária a.a. (12m) | 12,83% |
| Índice de Sharpe (12m) | 0,18 |

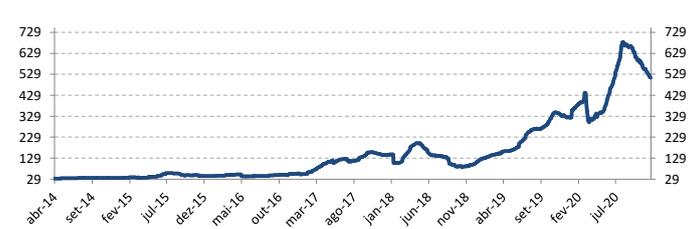
Histograma de Retornos



Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe



Evolução do PL (Milhões)



¹Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Maximum Drawdown é o declínio do valor máximo da cota até seu valor mínimo, calculado desde a constituição do fundo. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito - FGC. É recomendada a leitura cuidadosa do formulário de informações complementares, da lâmina de informações essenciais e do regulamento antes de investir. Supervisão e fiscalização: Comissão de Valores Mobiliários - CVM, Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br. Para mais informações, visite nosso site: www.icatu Vanguarda.com.br ou entre em contato pelo número (21) 3824-7107.

