

Material de Divulgação do Fundo

junho/2020

CNPJ
11.098.129/0001-09

Nome do fundo
LEBLON ICATU PREVIDENCIA FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

Gestor
LEBLON EQUITIES GESTAO DE RECURSOS LTDA

Administrador
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.

Custodiante
BANCO BRADESCO S.A.

Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES

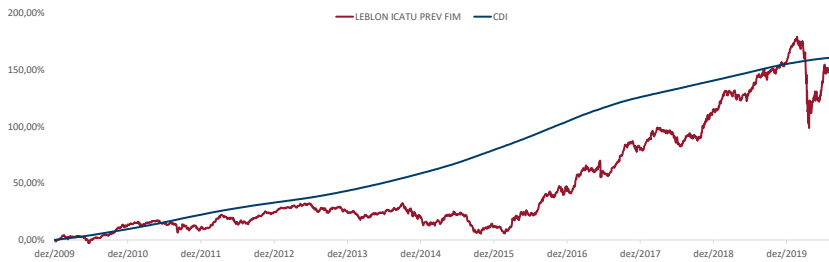
Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência Multimercado Livre
Classificação CVM Fundo Multimercado
Código Anbima 238805
Código SIN BRLSLDTF000
Lançamento 02/12/2009
Benchmark CDI
Cota Fechamento
Aplicações Depósito em D+0
Cota em D+1
Cota em D+1
Resgate Liquidação em D+4
Pagamento em até D+5 (prazo dos planos)
Mínima: 2,00%
Taxa de administração Máxima: 2,00%
Efetiva: 2,00%
Mínima: Não há
Máxima: Não há
Taxa de performance Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O objetivo do FUNDO consiste em procurar agregar valor ao seu patrimônio mediante uma gestão ativa de investimentos, utilizando estratégia diversificada, que envolva vários fatores de risco, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial e com utilização de operações em mercado de derivativos apenas para fins de proteção da carteira, com objetivo de atingir rentabilidade superior ao CDI, por meio da adoção de uma gestão ativa. A metodologia de análise fundamentalista será utilizada como meio para identificar distorções relevantes entre o preço de negociação e o valor intrínseco dos ativos com o objetivo de atingir elevados retornos absolutos no longo no mercado de ações no Brasil.

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.

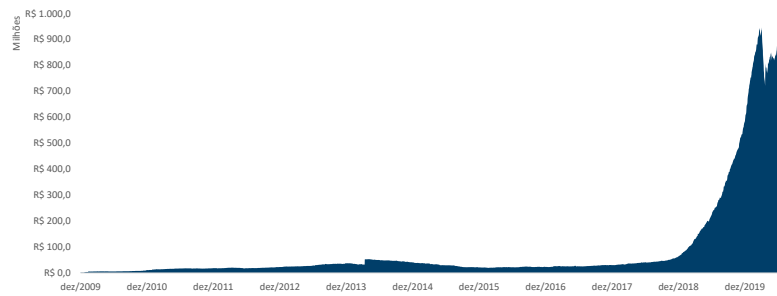
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2016	Fundo	-3,10%	3,68%	5,51%	5,27%	-2,84%	1,97%	9,86%	2,69%	-0,96%	6,23%	0,03%	-1,30%	29,58%	44,92%
	Benchmark %CDI	1,05%	1,00%	1,16%	1,05%	1,11%	1,16%	1,11%	1,21%	1,11%	1,11%	1,05%	1,12%	14,00%	106,62%
2017	Fundo	7,75%	3,41%	1,11%	-0,24%	-1,90%	-1,00%	4,49%	5,13%	5,35%	0,22%	-2,15%	3,30%	27,96%	85,44%
	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%	127,13%
2018	Fundo	714,40%	394,58%	105,60%	-30,57%	-205,20%	-123,86%	563,14%	640,56%	839,32%	33,44%	-379,24%	614,57%	281,71%	67,20%
	Benchmark %CDI	5,30%	1,27%	-0,42%	-0,23%	-4,59%	-1,28%	3,61%	-0,04%	-0,21%	8,77%	3,40%	1,27%	17,46%	117,82%
2019	Fundo	909,21%	274,08%	-79,91%	-43,83%	-886,60%	-247,42%	664,98%	-6,81%	-45,47%	1614,25%	689,62%	256,40%	271,93%	83,14%
	Benchmark %CDI	5,98%	-0,67%	-0,83%	0,30%	1,64%	2,64%	2,86%	1,35%	1,01%	0,92%	1,42%	5,48%	24,18%	170,47%
2020	Fundo	0,43%	-4,16%	-17,10%	5,32%	4,78%	5,00%							-7,54%	150,09%
	Benchmark %CDI	0,38%	0,29%	-0,34%	0,28%	0,24%	0,21%							1,75%	160,62%
		114,94%	-1416,76%	-5052,32%	1867,28%	2025,10%	2356,88%							-429,54%	93,45%

Evolução do Patrimônio Líquido



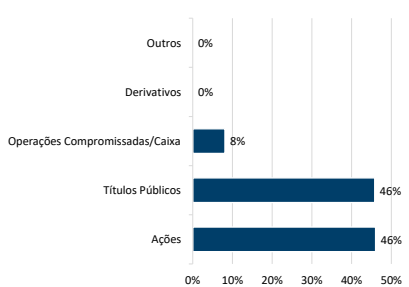
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	2	47
Nº Meses >0	10	79
Nº Meses <Benchmark	2	61
Nº Meses >Benchmark	10	65
Maior Rentabilidade Mensal	5,48%	9,86%
Menor Rentabilidade Mensal	-17,10%	-17,10%
Maximum Drawdown	28,88%	28,88%
Volatilidade Anualizada	21,24%	10,90%
Índice de Sharpe	0,02	-0,30

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	15,87%	0,73%	2159,93%
Últimos 6 meses	-7,54%	1,75%	-429,54%
Últimos 12 meses	5,11%	4,60%	111,10%
Últimos 24 meses	35,14%	11,21%	313,41%
Últimos 36 meses	58,11%	19,39%	299,70%
Últimos 48 meses	102,27%	34,73%	294,45%
Últimos 60 meses	104,75%	53,72%	194,98%
Desde o início	150,09%	160,62%	93,45%

Composição da Carteira*



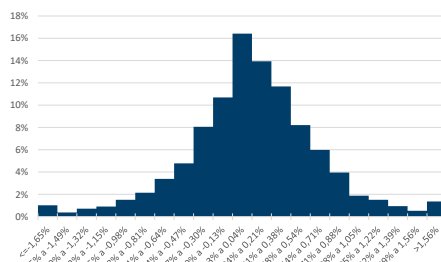
Data da carteira: jun/2020

*Número de aberturas consecutivas: 5

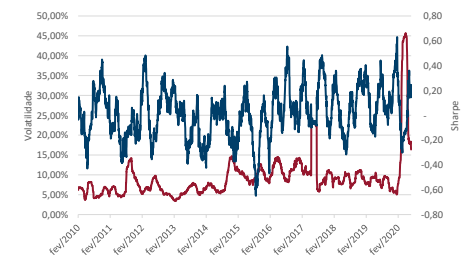
Patrimônio Líquido

	Atual	RS
Patrimônio Líquido	Médio nos últimos 12 meses	RS 909.864.498,29
	Médio desde o início	RS 639.565.360,58
		RS 91.126.159,12

Histograma dos Retornos Diários



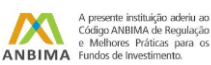
Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe*



*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)



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.