

Material de Divulgação do Fundo

setembro/2023

CNPJ
12.823.627/0001-21

Nome do fundo

ICATU VANGUARDA FIC DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA INFLAÇÃO CURTA PREVIDENCIÁRIO

Gestor

ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administrador

BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.

Custodiante

BANCO BRASESCO S.A.

Auditor independente

ERNST & YOUNG AUDITORES INDEPENDENTES S/S LTDA.

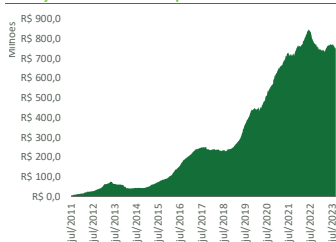
Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	Dif.
Últimos 3 meses	1,52%	1,73%	-0,20%
Últimos 6 meses	3,83%	4,32%	-0,49%
Últimos 12 meses	10,21%	11,65%	-1,44%
Últimos 24 meses	19,29%	21,97%	-2,68%
Últimos 36 meses	24,91%	29,23%	-4,32%
Últimos 48 meses	32,41%	38,58%	-6,17%
Últimos 60 meses	51,46%	59,92%	-8,46%
Desde o início	219,82%	266,50%	-46,68%

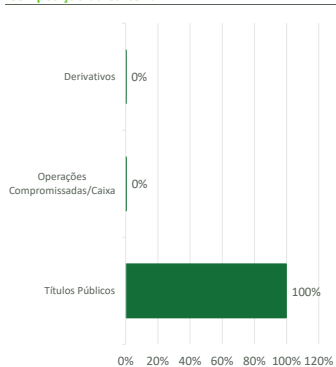
Patrimônio Líquido

Atual	R\$	750.720.176,75
Médio nos últimos 12 meses	R\$	756.507.954,01
Médio desde o início	R\$	306.382.049,54

Evolução do Patrimônio Líquido



Composição da Carteira*



Data da carteira: set/2023

*Número de aberturas consecutivas: 5

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

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.

Política de Investimento

O FUNDO investirá seus recursos em cotas de fundos de investimento ou cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento de Renda Fixa, 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.

Informações do fundo

Classificação Anbima	Previdência RF Indexados
Classificação CVM	Fundo de Renda Fixa
Código Anbima	282499
Código ISIN	BRSE62CTF008
Lançamento	25/07/2011
Benchmark	IMA-B 5
Taxa de administração	Mínima: 0,75% Máxima: 1,00% Efetiva: 1,00% Mínima: Não há
Taxa de performance	Máxima: Não há Efetiva: Não há Depósito em D+0 Cota em D+0
Aplicações (Dias úteis)	Depósito em D+0 Cota em D+0 Liquidação em D+1
Resgate (Dias úteis)	Pagamento de acordo com o prazo dos planos*
Cota	Fechamento

Risco

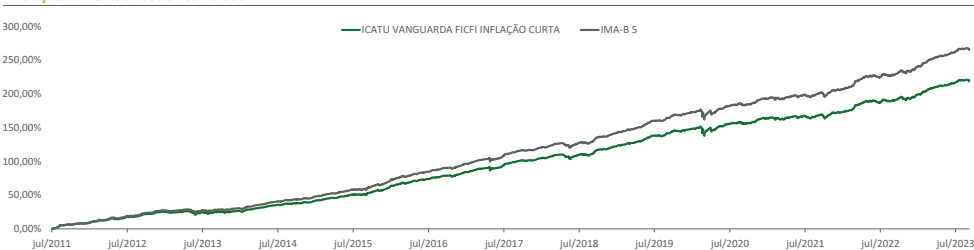


Permissões

Limite de aplicação em ativos no exterior	0%
Limite de aplicação em crédito privado	50%
Utiliza derivativos para proteção?	Sim

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2019	Fundo	1,47%	0,45%	0,70%	1,01%	1,32%	1,67%	0,86%	-0,05%	1,68%	1,60%	-0,43%	1,16%	12,05%	147,18%
	Benchmark	1,54%	0,55%	0,78%	1,11%	1,39%	1,72%	0,97%	0,05%	1,74%	1,65%	-0,28%	1,24%	13,15%	171,38%
	Dif.	-0,07%	-0,09%	-0,08%	-0,09%	-0,06%	-0,04%	-0,11%	-0,10%	-0,06%	-0,05%	-0,15%	-0,08%	-1,11%	-24,21%
2020	Fundo	0,48%	0,56%	-1,91%	0,43%	2,08%	1,01%	0,95%	0,28%	-0,29%	0,11%	1,25%	1,78%	6,86%	164,13%
	Benchmark	0,56%	0,64%	-1,75%	0,49%	2,12%	1,12%	0,99%	0,43%	-0,12%	0,20%	1,32%	1,83%	8,04%	193,20%
	Dif.	-0,07%	-0,08%	-0,16%	-0,06%	-0,04%	-0,11%	-0,04%	-0,15%	-0,16%	-0,09%	-0,07%	-0,05%	-1,18%	-29,08%
	Fundo	0,00%	-0,69%	0,21%	0,81%	0,59%	-0,22%	-0,11%	0,02%	0,89%	-1,30%	2,43%	0,69%	3,33%	172,91%
	Benchmark	0,11%	-0,60%	0,34%	0,87%	0,69%	-0,13%	0,03%	0,15%	1,00%	-1,24%	2,50%	0,79%	4,57%	206,59%
	Dif.	-0,11%	-0,09%	-0,13%	-0,06%	-0,10%	-0,09%	-0,14%	-0,13%	-0,11%	-0,06%	-0,07%	-0,10%	-1,24%	-33,67%
2021	Fundo	0,02%	0,99%	2,50%	1,47%	0,69%	0,26%	-0,07%	-0,06%	0,38%	1,82%	-0,72%	0,85%	8,40%	195,83%
	Benchmark	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%	1,91%	-0,33%	0,94%	9,78%	236,58%
	Dif.	-0,09%	-0,07%	-0,11%	-0,08%	-0,09%	-0,07%	-0,08%	-0,06%	-0,04%	-0,10%	-0,39%	-0,09%	-1,39%	-40,75%
2022	Fundo	1,30%	1,33%	1,43%	0,83%	0,49%	0,94%	0,90%	0,54%	0,08%				8,11%	219,82%
	Benchmark	1,40%	1,41%	1,52%	0,90%	0,57%	1,05%	0,97%	0,61%	0,13%				8,89%	266,50%
	Dif.	-0,09%	-0,08%	-0,09%	-0,07%	-0,09%	-0,11%	-0,07%	-0,07%	-0,05%				-0,78%	-46,68%

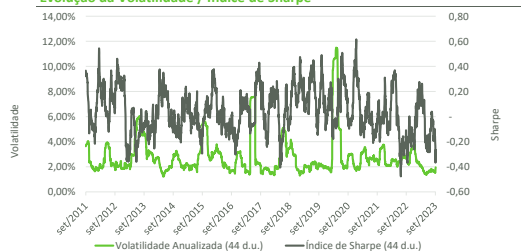
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	1	24
Nº Meses >0	11	122
Nº Meses <Benchmark	12	146
Nº Meses >Benchmark	0	0
Maior Rentabilidade Mensal	1,82%	3,85%
Menor Rentabilidade Mensal	-0,72%	-1,91%
Maximum Drawdown	1,66%	5,60%
Volatilidade Anualizada	2,27%	3,12%
Índice de Sharpe	-1,43	2,84

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.