

CAPITÂNIA CREDPREVIDÊNCIA ICATU FIC FI RF CP

Material de Divulgação do Fundo

dezembro/2023

CNPJ

27.239.065/0001-40

Nome do fundo

CAPITÂNIA CREDPREVIDÊNCIA ICATU FIC DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO

Gestor

CAPITANIA PREV S.A.

Administrador

BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.

Custodante

BNY MELLON BANCO S.A.

Auditor independente

DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

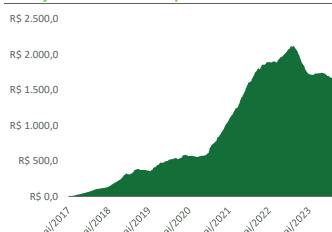
Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	2,76%	2,83%	97,41%
Últimos 6 meses	6,05%	6,14%	98,45%
Últimos 12 meses	11,35%	13,04%	87,07%
Últimos 24 meses	25,11%	27,05%	92,85%
Últimos 36 meses	33,57%	32,67%	102,77%
Últimos 48 meses	39,08%	36,32%	107,57%
Últimos 60 meses	48,02%	44,45%	108,03%
Desde o início	72,45%	61,72%	117,38%

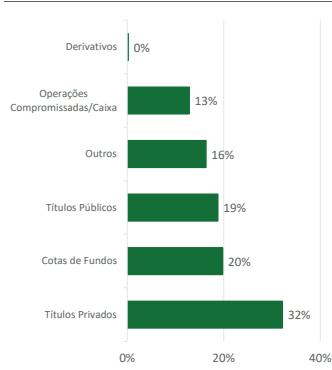
Patrimônio Líquido

Atual	R\$ 1.665.767.939,24
Médio nos últimos 12 meses	R\$ 1.793.818.415,43
Médio desde o início	R\$ 926.164.374,44

Evolução do Patrimônio Líquido



Composição da Carteira*



Data da carteira: dez/2023

*Número de aberturas consecutivas: 5

Objetivo do fundo

A política de investimento do FUNDO consiste em utilizar perfil não referenciado em indicador de desempenho em função da estrutura dos ativos financeiros e/ou modalidades operacionais integrantes da carteira, visando atingir rentabilidade superior às taxas diárias de remuneração de certificados de depósito interfinanceiro - CDI, tendo como principal fator de risco a variação da taxa de juros domésticas e/ou índices de preços. O FUNDO poderá aplicar os recursos integrantes de sua carteira em quaisquer ativos financeiros permitidos pela ANBIMA.

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 – PGL e de Vida Gerador de Benefício Livre - VGL 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

A política de investimento do FUNDO consiste em aplicar, no mínimo, 95% de seu patrimônio líquido em cotas do CAPITÂNIA CREDPREVIDÊNCIA MÁSTER FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO.

Informações do fundo

Classificação Anbima: Previdência RF Duração Livre Crédito Liv
Classificação CVM: Fundo de Renda Fixa
Código Anbima: 441104
Código ISIN: BRCM3I3CTF002

Lançamento

22/05/2017

Benchmark

CDI

Taxa de administração

Minima: 0,50%
Máxima: 1,25%

Efetiva: 1,24%

Minima: Não há
Máxima: Não há

Taxa de performance

Máxima: Não há

Efetiva: Não há

Depósito em D+0

Aplicações (Dias úteis)

Cota em D+0
Cota em D+1
Liquidação em D+4

Resgate (Dias úteis)

Pagamento de acordo com o prazo dos planos*

Cota

Fechamento

Risco

Menor Risco	Maior Risco
1	5

Permissões

Limite de aplicação em ativos no exterior

0%

Limite de aplicação em crédito privado

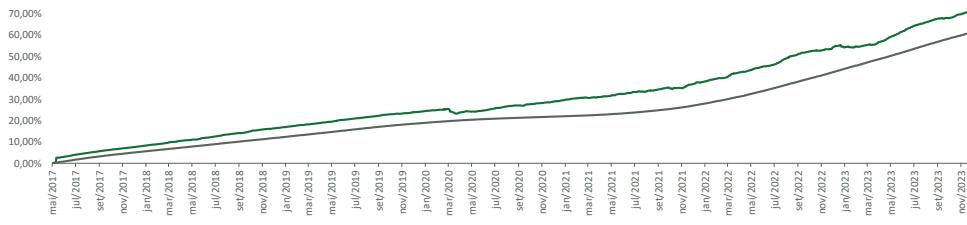
65%

Utiliza derivativos para proteção?

Sim

	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2019	Fundo	0,61%	0,54%	0,44%	0,57%	0,59%	0,61%	0,55%	0,52%	0,65%	0,40%	0,34%	0,44%	6,43%
	Benchmark	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%	0,48%	0,38%	0,37%	5,96%
	%CDI	112,62%	109,49%	93,18%	110,42%	108,23%	129,41%	97,02%	102,90%	139,71%	83,79%	89,13%	116,45%	107,87%
2020	Fundo	0,49%	0,35%	-0,80%	-0,01%	0,05%	0,66%	0,78%	0,73%	0,13%	0,61%	0,54%	0,52%	4,12%
	Benchmark	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	0,15%	0,15%	0,16%	2,76%
	%CDI	130,89%	118,37%	-235,42%	-2,25%	26,94%	309,07%	400,43%	454,23%	83,99%	387,17%	359,58%	314,65%	149,45%
2021	Fundo	0,61%	0,56%	0,13%	0,40%	0,36%	0,70%	0,70%	0,29%	0,54%	0,19%	0,61%	1,48%	6,76%
	Benchmark	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	4,42%
	%CDI	411,20%	413,02%	63,96%	191,47%	131,64%	228,15%	198,01%	122,45%	38,26%	104,39%	191,99%	152,81%	138,63%
2022	Fundo	0,61%	0,79%	1,28%	0,88%	1,07%	0,76%	1,02%	2,03%	1,19%	0,63%	0,39%	1,07%	12,36%
	Benchmark	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,39%
	%CDI	83,95%	105,25%	137,70%	105,24%	103,59%	75,13%	172,88%	110,79%	61,39%	38,06%	95,56%	99,72%	127,40%
2023	Fundo	-0,10%	-0,13%	0,65%	1,03%	1,71%	1,76%	1,32%	1,03%	0,81%	0,31%	1,17%	1,26%	11,35%
	Benchmark	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,89%	13,04%
	%CDI	-9,19%	-14,32%	55,72%	112,05%	152,65%	163,95%	123,22%	90,52%	83,63%	31,02%	127,70%	140,82%	87,07%

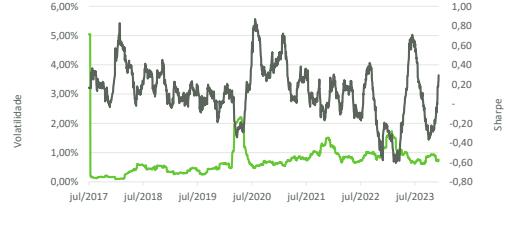
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	2	4
Nº Meses >0	10	75
Nº Meses <Benchmark	6	26
Nº Meses >Benchmark	6	53
Maior Rentabilidade Mensal	1,76%	2,91%
Menor Rentabilidade Mensal	-0,13%	-0,80%
Maximum Drawdown	0,80%	1,79%
Volatilidade Anualizada	1,04%	1,18%
Índice de Sharpe	-1,63	3,56

Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe*



*Índice calculado a partir da razão entre a média do retorno diário acima do cdí e a volatilidade diária.

Volatilidade

Sharpe

Volatilidade Anualizada (44 d.u.)

Índice de Sharpe (44 d.u.)