ICATU VANGUARDA MULTIESTRATÉGIA ARROJADO FIC FIM PREV

Material de Divulgação do Fundo — **fevereiro/2022**

CNPJ
03.537.456/0001-83

Nome do fundo
ICATU VANGUARDA MULTIESTRATÉGIA ARROJADO FIC DE FIM PREVIDENCIÁRIO

Gestor
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Administrador
BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.

Custodiante
BANCO BRADESCO S.A.

Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

Informações do fundo

Classificação Anbima	Previdência Multimercado Livre
Classificação CVM	Fundo Multimercado
Código Anbima	337455
Código ISIN	BRIHP1CTF008
Lançamento	21/12/2012
Benchmark	Não há
Cota	Fechamento
Aplicações (Dias úteis)	Depósito em D+0 Cota em D+1
Resgate (Dias úteis)	Cota em D+1 Liquidação em D+2 Pagamento de acordo com o prazo dos planos*
Taxa de administração	Mínima: 0,93% Máxima: 1,50%
Taxa de performance	Efetiva: 1,38% Mínima: 0,00% Máxima: Não há Efetiva: Não há

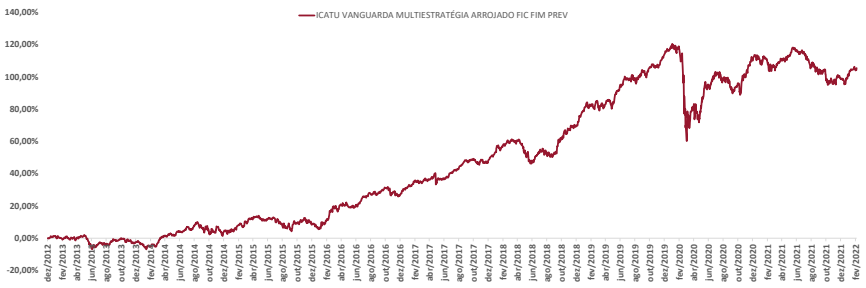
Objetivo do fundo

O Fundo tem por objetivo superar no longo prazo a rentabilidade de uma carteira teórica cuja composição seja 55% (cinquenta e cinco por cento) em ativos financeiros atrelados a índices de inflação (com vencimentos até 5 anos) e 45% (quarenta e cinco por cento) em ações que apresentem fundamentos sólidos e pagamentos de dividendos consistentes, através de investimentos em cotas de fundos de investimento ou cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento ("Fundos Investidos"), negociados no mercado interno, para tanto, os "FUNDOS INVESTIDOS" poderão alocar seus investimentos em qualquer classe de ativos financeiros disponíveis no mercado, dentre elas renda fixa, renda variável, cambial, derivativos e cotas de outros fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo, com ou sem compromisso de concentração em classe específica, 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 Investimento, recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre – PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre - VGBL (conjuntamente os "Planos"), disciplinados pela Resolução do Conselho Monetário Nacional no 4.444 de 13.11.2015 (Res. CMN no 4.444/15), destinados a proponentes não qualificados, instituídos pela Icatu Seguros S.A, doravante designado Cotista ou Instituidora, Investidor Profissional nos termos da Instrução CVM no 539, de 13.11.2013 (ICVM 539/13) e posteriores alterações.

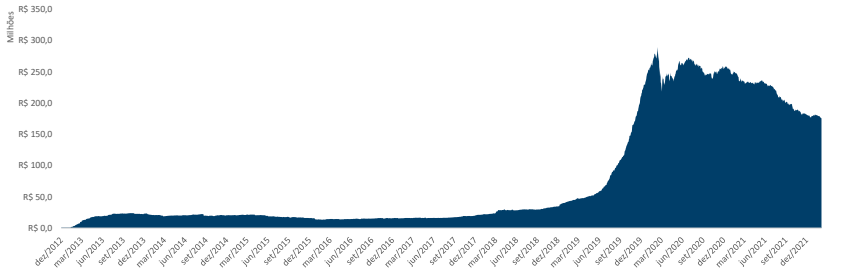
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2018	Fundo	4,85%	-0,03%	2,67%	-0,35%	-5,89%	-1,80%	3,24%	-0,90%	0,62%	7,83%	2,62%	1,70%	14,81%	72,17%
	Benchmark														
	Dif.														
2019	Fundo	6,33%	-0,69%	-0,10%	2,20%	1,89%	3,24%	1,54%	0,67%	2,07%	1,69%	0,00%	4,11%	25,26%	115,66%
	Benchmark														
	Dif.														
2020	Fundo	0,65%	-3,18%	-17,33%	3,47%	3,67%	4,51%	3,61%	-2,57%	-3,11%	-0,86%	7,22%	5,48%	-0,96%	113,59%
	Benchmark														
	Dif.														
2021	Fundo	-2,54%	-2,11%	2,01%	1,13%	2,36%	-0,04%	-1,94%	-1,66%	-2,51%	-3,58%	0,61%	1,29%	-6,97%	98,69%
	Benchmark														
	Dif.														
2022	Fundo	2,60%	0,78%											3,41%	105,47%
	Benchmark														
	Dif.														

Evolução do Patrimônio Líquido



Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o inicio
Nº Meses <0	5	40
Nº Meses >0	7	70
Nº Meses <Benchmark	-	-
Nº Meses >Benchmark	-	-
Maior Rentabilidade Mensal	2,60%	7,83%
Menor Rentabilidade Mensal	-3,58%	-17,33%
Maximum Drawdown	11,56%	27,34%
Volatilidade Anualizada	7,97%	10,90%
Índice de Sharpe	-0,60	-0,11

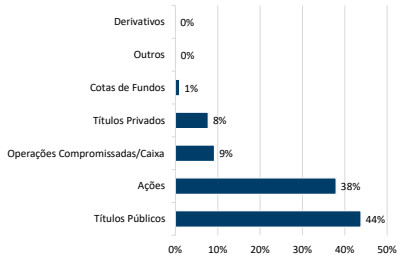
Patrimônio Líquido

Atual	R$	176.063.171,11
Médio nos últimos 12 meses	R$	208.554.993,89
Médio desde o inicio	R$	76.807.687,04

Rentabilidades Acumuladas

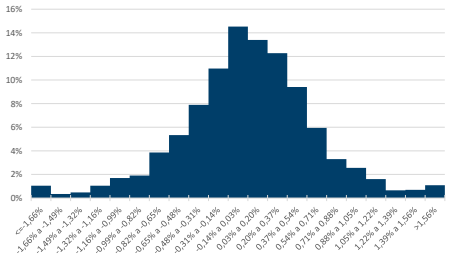
Período	Fundo	Benchmark	Dif.
Últimos 3 meses	4,74%		
Últimos 6 meses	-0,95%		
Últimos 12 meses	0,83%		
Últimos 24 meses	-2,23%		
Últimos 36 meses	13,02%		
Últimos 48 meses	30,73%		
Últimos 60 meses	52,31%		
Desde o inicio	105,47%		

Composição da Carteira***

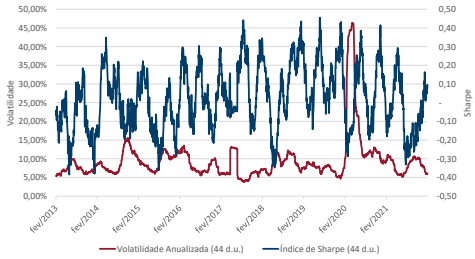


Data da carteira: jan/2022
***Número de aberturas consecutivas: 5

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.

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

* De acordo com as Circulares SUSEP nº 563/564 de 2017, para planos destinados à proponentes varejo e qualificados aprovados a partir de 1° de janeiro de 2018, o prazo para crédito é de até 10 (dez) dias úteis e 180 (cento e oitenta) dias úteis, respectivamente, e para planos anteriores a 1° 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 distanciamentos 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)