

## Informações Gerais

Público Alvo	Investidores em geral
Classificação ANBIMA	Multimercados Macro
CNPJ	22.504.092/0001-80
Código ANBIMA	632880
Gestor	Icatu Vanguarda Gestão de Recursos
Administrador	BEM DTVM
Custodiante	Banco Bradesco S/A
Status	Aberto
Início	21/08/2015
Benchmark	CDI
PL Atual	R\$ 91.803.404
PL Médio (12m)	R\$ 93.394.150
Taxa de Administração	1,500% a.a.
Taxa de Performance	20% s/ 100% do CDI
Periodicidade	Anual
Aplicação Mínima Inicial*	R\$ 500,00
Movimentação Mínima*	R\$ 500,00
Saldo Mínimo Permanência*	R\$ 500,00
Horário de Movimentação*	Até as 14h
Aplicações	Depósito em
(dias úteis)	D+0
Resgate	Cota em
(dias úteis)	D+1
Pagamento em	D+1 DU (da conversão)
Tributação	IR
	Aliquota 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
	Aliquota regressiva sobre o rendimento de aplicações de prazo inferior a 30 dias
Dados para Aplicação:	Banco
	237
	Agência
	2856-8
Conta Corrente	009680-6
Favorecido	

## Nível de Risco



## Descrição

O fundo busca atingir retornos significativamente superiores ao CDI por meio da utilização de estratégias baseadas em operações direcionais nos mercados local e internacional de taxas de juros, câmbio, ações, índice de ações e títulos da dívida pública, tanto no mercado à vista quanto nos seus derivativos. As operações de arbitragem deverão ter papel secundário no resultado do fundo, priorizando operações que estejam relacionadas a movimentos específicos de mercado e buscando uma diversificação eficiente da carteira.

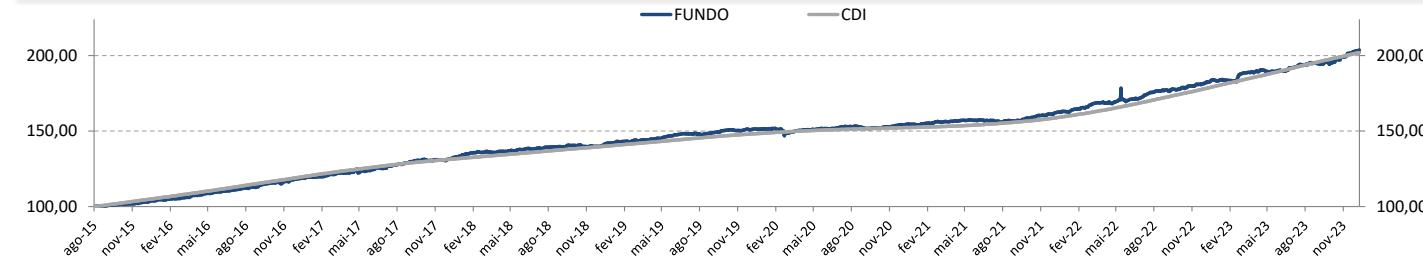
## Tabela de Rentabilidades¹

	2023		2022		2021		2020	
	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI
janeiro	0,83%	74,00%	0,39%	52,90%	-0,36%	-	-0,06%	-
fevereiro	-0,40%	-	1,33%	176,91%	0,54%	404,92%	-0,16%	-
março	2,91%	248,10%	1,91%	206,51%	0,86%	435,54%	-0,98%	-
abril	0,30%	32,43%	0,09%	10,30%	0,34%	162,86%	0,84%	296,27%
maio	0,09%	7,69%	1,22%	118,26%	0,30%	111,64%	0,34%	140,48%
junho	0,31%	28,93%	0,36%	35,75%	0,10%	32,61%	0,09%	43,57%
julho	1,47%	137,43%	1,53%	147,44%	-0,46%	-	0,82%	423,91%
agosto	1,28%	112,47%	1,47%	125,49%	0,16%	38,02%	0,18%	113,79%
setembro	0,00%	-	0,15%	13,89%	-0,04%	-	-0,78%	-
outubro	0,27%	27,34%	1,19%	116,98%	1,52%	315,82%	-0,05%	-
novembro	2,64%	287,85%	1,16%	113,25%	0,75%	127,70%	0,90%	600,26%
dezembro	1,41%	157,40%	0,86%	76,95%	1,37%	179,39%	0,93%	565,16%

	2023		2022		2021		2020	
	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI
Acum Ano	11,64%	89,19%	12,26%	99,11%	5,17%	117,69%	2,08%	75,12%
Acum Início	103,68%	101,67%	82,44%	104,81%	62,52%	105,98%	54,52%	104,26%

	6 meses		12 meses		24 meses		36 meses	
	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI
Retornos	7,27%	118,19%	11,64%	89,19%	25,33%	93,68%	31,81%	97,52%

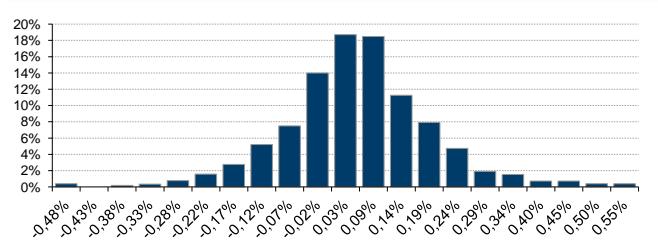
## Rentabilidade Acumulada x CDI



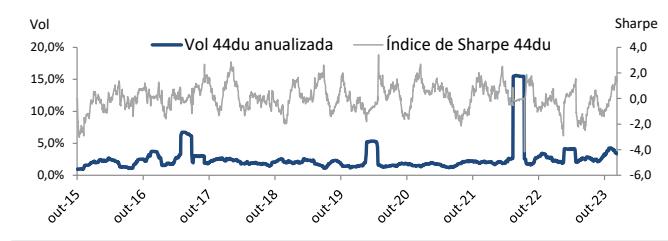
## Estatísticas de 2020 a 2023

Descrição	Estatísticas
Nº Meses >0	38 (79%)
Nº Meses <0	10 (21%)
Nº Meses >Benchmark	25 (52%)
Nº Meses <Benchmark	23 (48%)
Maior Rentabilidade Mensal	2,91% - 03/2023
Menor Rentabilidade Mensal	-0,98% - 03/2020
Maximum Drawdown¹	-5,02%
Volatilidade Diária a.a. (12m)	3,07%
Índice de Sharpe (12m)	-0,45

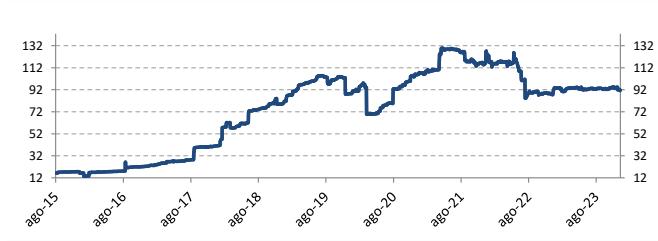
## Histograma de Retornos



## 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](http://www.cvm.gov.br). Para mais informações, visite nosso site: [www.icatuvanguarda.com.br](http://www.icatuvanguarda.com.br) ou entre em contato pelo número (21) 3824-7107.

\*As informações referentes à aplicação mínima inicial, movimentação mínima, saldo mínimo de permanência e o horário de movimentação podem ser diferentes para clientes que realizam movimentações via conta e ordem, favor verificar junto ao distribuidor e consulte o regulamento.