TAGUS ICATU PREVIDÊNCIA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO

Material de Divulgação do Fundo — **outubro/2024**

CNPJ
50.925.001/0001-15

Nome do fundo
TAGUS ICATU PREVIDÊNCIA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO

Gestor
TAGUS INVESTIMENTOS LTDA

Administrador
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S/A DTVM

Custodiante
BANCO BTG PACTUAL S/A

Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

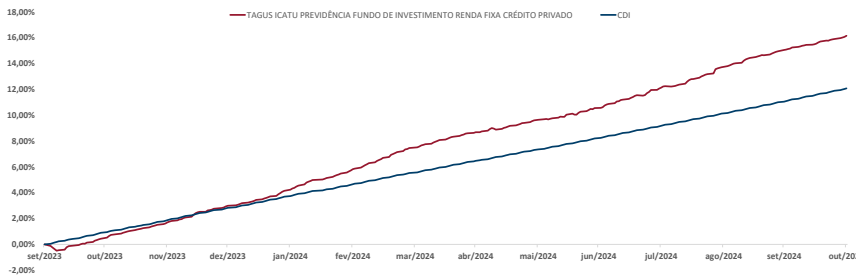
Informações do fundo

Classificação Anbima	Previdência RF Duração Livre Crédito Liv
Classificação CVM	Fundo de Renda Fixa
Código Anbima	C0000727792
Código ISIN	BR0FSXCTF008
Lançamento	29/09/2023
Benchmark	CDI
Cota	Fechamento
Aplicações (Dias úteis)	Depósito em D+0 Cota em D+0
Resgate (Dias úteis)	Cota em D+6 Liquidação em D+8 Pagamento de acordo com o prazo dos planos*
Taxa de administração	Mínima: 1,00% Máxima: 1,00% Efetiva: 1,00%
Taxa de performance	Mínima: 0,00% Máxima: Não há, mas poderá comprar cotas de fundos de investimento que possuem de taxa de performance Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O fundo tem por objetivo buscar retorno em ativos de renda fixa, admitindo-se estratégias com risco de juros e de índice de preços. Não possui o compromisso de manter limites mínimo ou máximo para duration média ponderada da carteira e pode investir mais de 20% da sua carteira em títulos de médio e alto risco de crédito do mercado doméstico ou externo.

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.

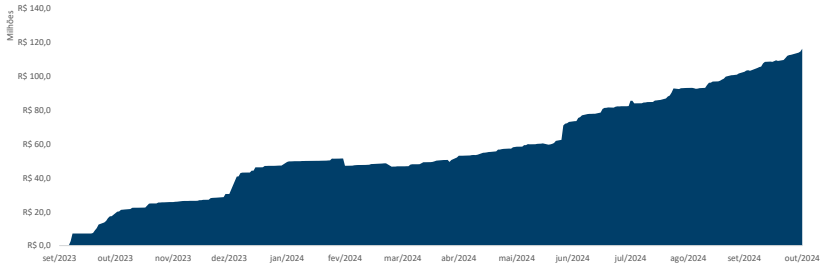
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2020	Fundo														
	Benchmark														
	%CDI														
2021	Fundo														
	Benchmark														
	%CDI														
2022	Fundo														
	Benchmark														
	%CDI														
2023	Fundo									0,00%	0,65%	1,11%	1,20%	2,99%	2,99%
	Benchmark									0,00%	1,00%	0,92%	0,89%	2,83%	2,83%
	%CDI										65,28%	120,82%	134,37%	105,43%	105,43%
2024	Fundo	1,35%	1,38%	1,55%	1,14%	0,89%	0,83%	1,43%	1,41%	1,18%	0,96%			12,78%	16,15%
	Benchmark	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,84%	0,93%			8,99%	12,08%
	%CDI	139,90%	172,25%	186,11%	128,18%	106,48%	105,10%	157,61%	162,58%	140,71%	102,99%			142,18%	133,72%

Evolução do Patrimônio Líquido



Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	0	0
Nº Meses >0	12	13
Nº Meses <Benchmark	0	1
Nº Meses >Benchmark	12	12
Maior Rentabilidade Mensal	1,55%	1,55%
Menor Rentabilidade Mensal	0,83%	0,65%
Maximum Drawdown	0,11%	0,49%
Volatilidade Anualizada	0,58%	0,67%
Índice de Sharpe	7,66	5,80

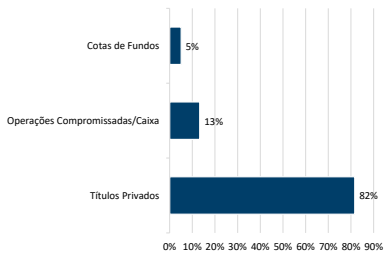
Patrimônio Líquido

Atual	R$	116.223.125,50
Médio nos últimos 12 meses	R$	62.241.339,64
Médio desde o início	R$	58.006.445,43

Rentabilidades Acumuladas

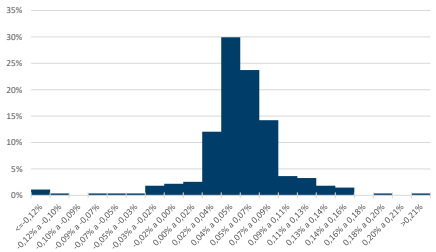
Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	3,58%	2,65%	135,01%
Últimos 6 meses	6,87%	5,27%	130,40%
Últimos 12 meses	15,40%	10,97%	140,36%
Últimos 24 meses			
Últimos 36 meses			
Últimos 48 meses			
Últimos 60 meses			
Desde o início	16,15%	12,08%	133,72%

Composição da Carteira***

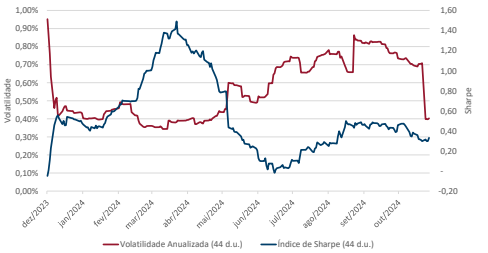


Data da carteira: out/2024
***Número de aberturas consecutivas: 5

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.
ANBIMA

* 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)