

# ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FIRF (Novembro/2024)

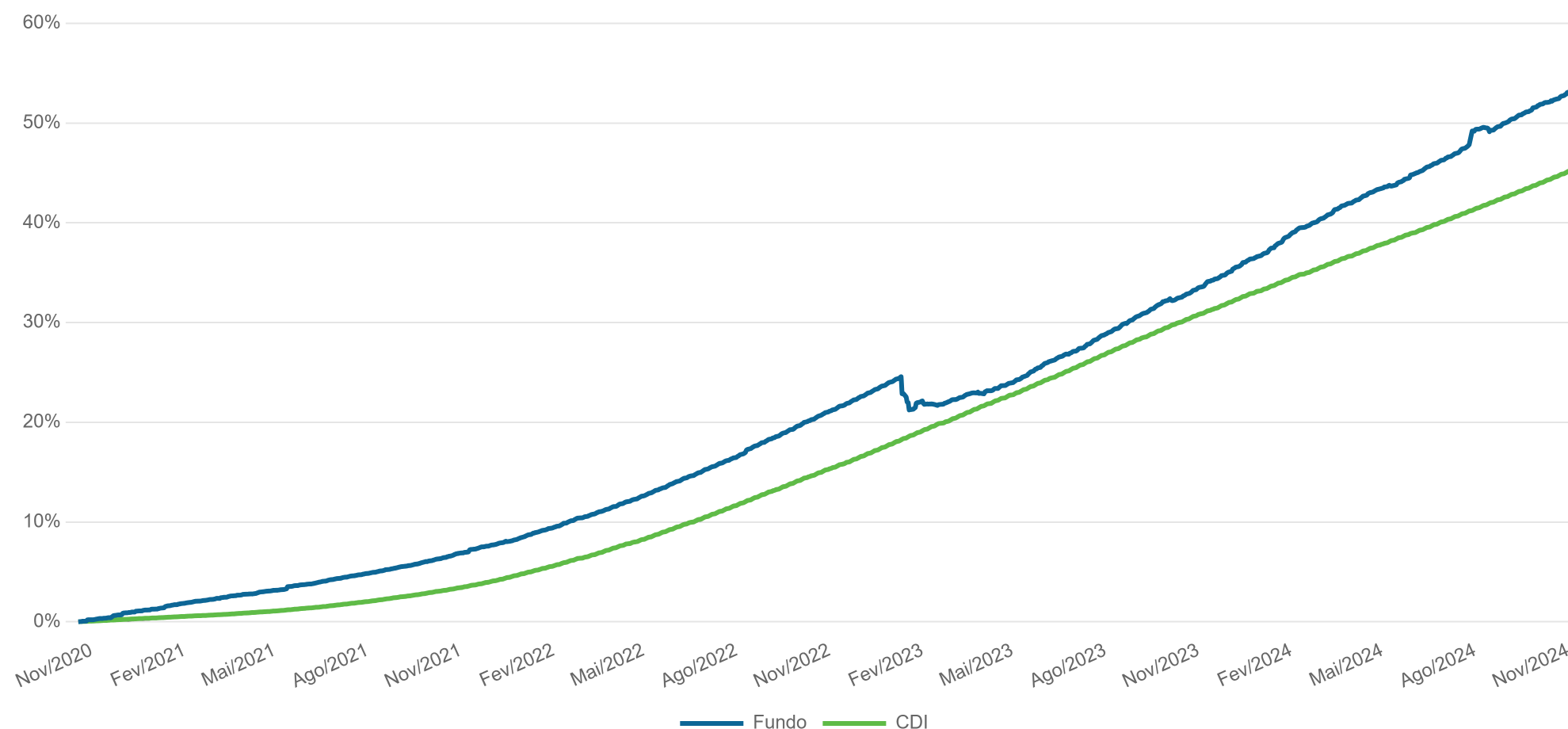
# ICATU | VANGUARDA

Adaptado à resolução CMN 4.994, este produto busca gerar retornos entre 1,00% e 1,50% acima do CDI nos médio e longo prazos através do investimento em uma carteira de crédito diversificada e focada em ativos de baixo risco de crédito.

Adequado  
Res. EAPC / EFPC

Status  
Aberto para Captação

### Retorno Acumulado



### Características

CNPJ	36.521.750/0001-56
Administrador	BEM DTVM
Custodiante	BRADESCO
Início	19/10/2020
Benchmark	CDI
PL Atual	R\$ 330.087.367
PL Médio (12m)	R\$ 433.450.463
Taxa de Administração	0,40%
Taxa de Performance	20% s/ 100% do CDI
Periodicidade	Semestral
Aplicação Inicial Mínima	R\$ 0
Movimentação Mínima	R\$ 0
Saldo Mínimo	R\$ 0
Aplicações (Cotização/Liquidação)	D+0 / D+0
Resgates (Cotização/Liquidação)	D+30 / DU+1 (da cotização)

Desempenho	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	36 Meses	Desde Início
Retorno Fundo	0,9%	13,0%	14,4%	26,1%	43,4%	54,4%
CDI	0,8%	9,9%	10,8%	25,6%	40,6%	46,2%
CDI+	0,1%	2,9%	3,2%	0,4%	2,0%	5,6%
CDI+ (Anualizado)	1,0%	3,1%	3,2%	0,2%	0,7%	1,3%
% CDI	109,3%	132,0%	132,4%	101,9%	106,9%	117,6%

Carteira de Crédito	Set-24	Out-24	Nov-24
%PL Investido	95,37%	93,67%	83,16%
Spread de Crédito	2,20%	2,36%	2,56%
Duration	2,74	2,63	2,75
Número de Emissores	117	116	111
%PL Médio por Emissor	0,82%	0,81%	0,75%
Maior Emissor	3,51%	3,68%	2,63%

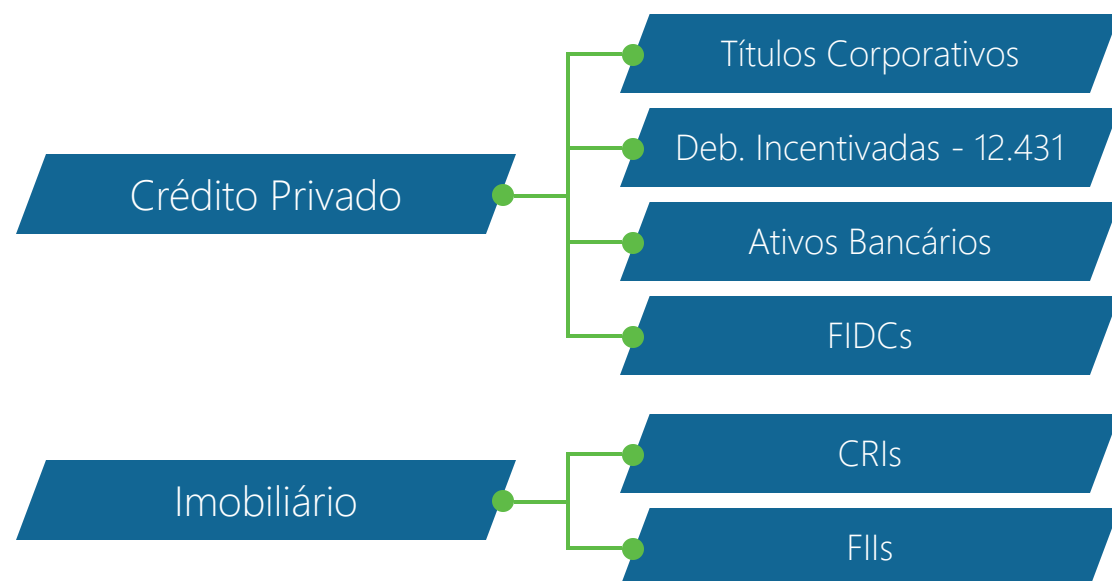
# ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FIRF (Novembro/2024)

Adaptado à resolução CMN 4.994, este produto busca gerar retornos entre 1,00% e 1,50% acima do CDI nos médio e longo prazos através do investimento em uma carteira de crédito diversificada e focada em ativos de baixo risco de crédito.

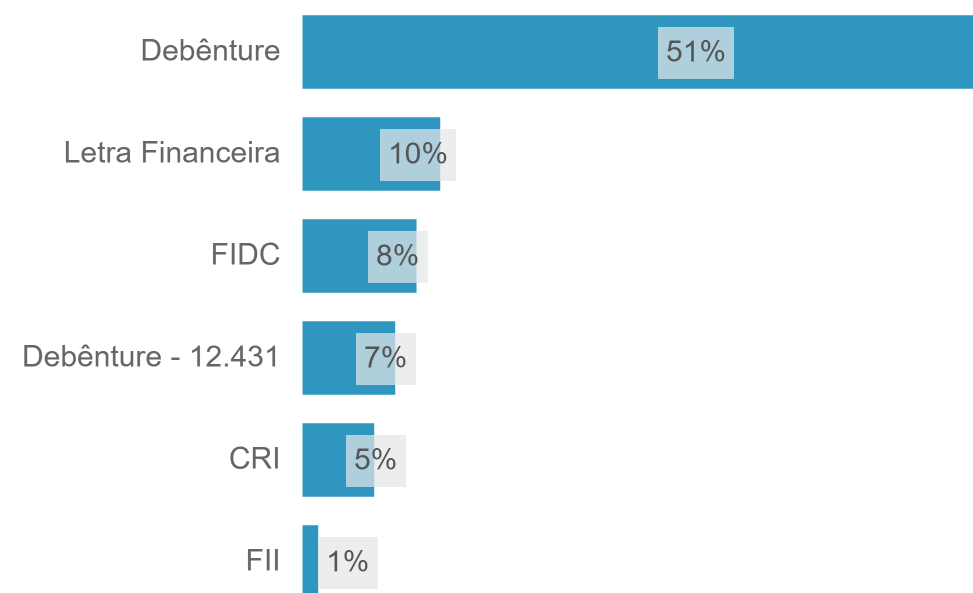
Adequado  
Res. EAPC / EFPC

Status  
Aberto para Captação

## Mercado de Atuação



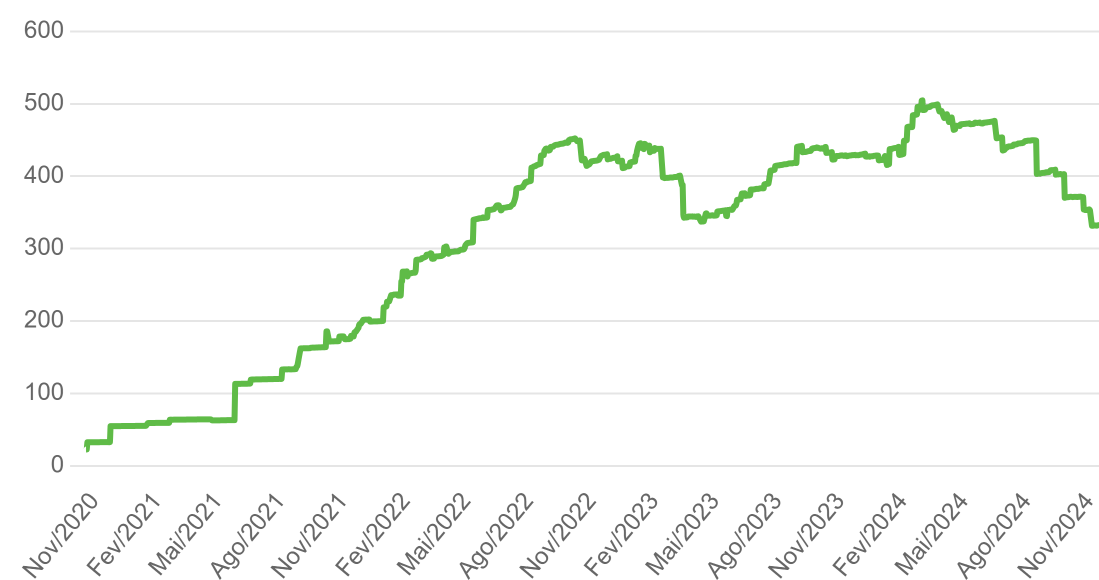
## Alocação



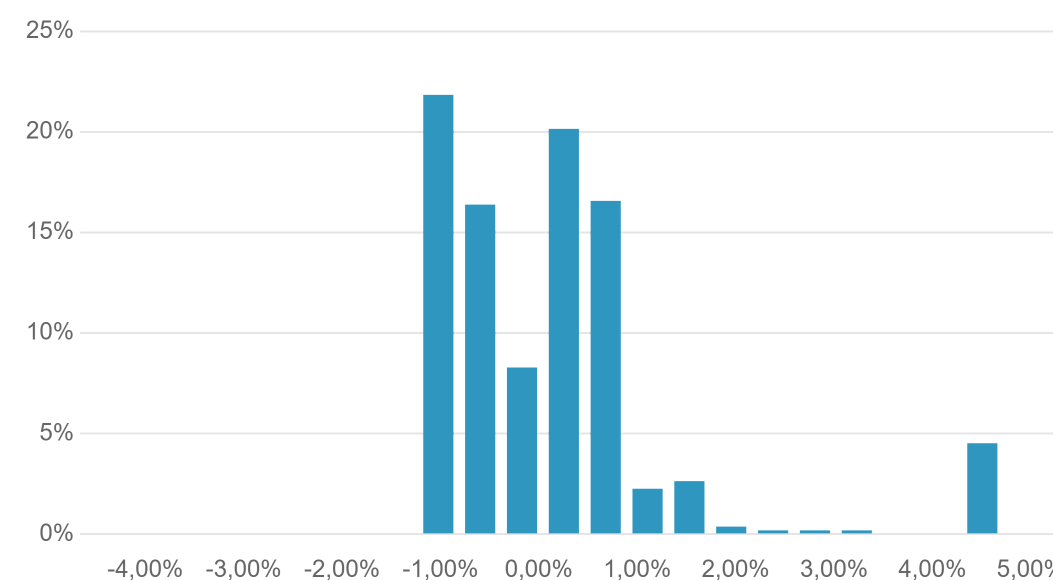
## Estatísticas

Descrição	Estatística
Nº Meses > 0	48 (96%)
Nº Meses < 0	2 (4%)
Nº Meses > Benchmark	43 (86%)
Nº Meses < Benchmark	7 (14%)
Maior Rentabilidade Mensal	2,00% (jul/24)
Menor Rentabilidade Mensal	-1,52% (jan/23)
Maximum Drawdown	-2,7%
Volatilidade Diária a.a. (12M)	1,0%

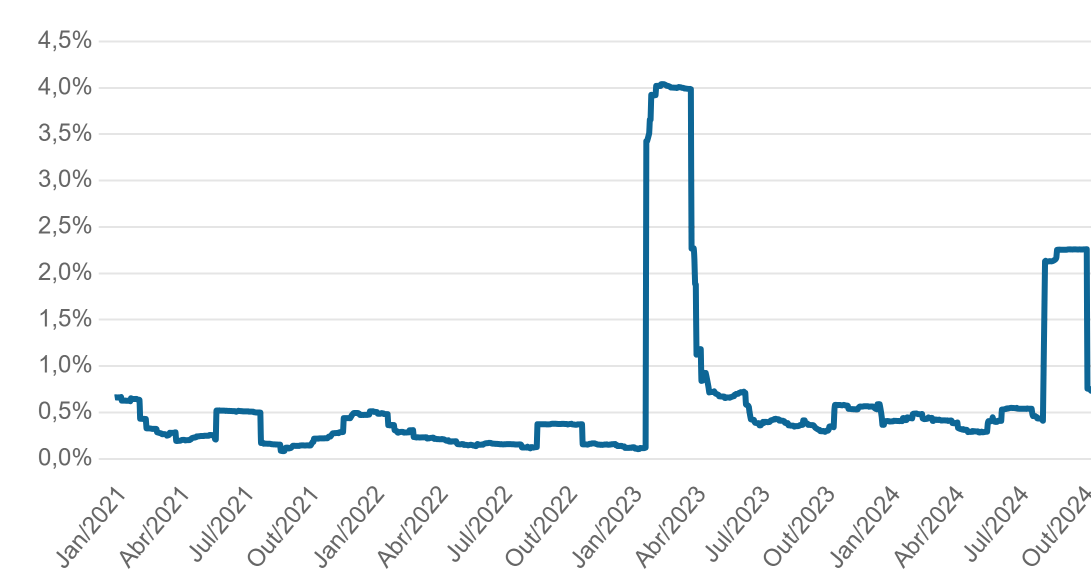
## Evolução AuM (R\$ Milhões)



## Histograma de Retornos em CDI+ (Janelas Móveis de 24m)



## Evolução da Volatilidade (44du Anualizada)



Adaptado à resolução CMN 4.994, este produto busca gerar retornos entre 1,00% e 1,50% acima do CDI nos médio e longo prazos através do investimento em uma carteira de crédito diversificada e focada em ativos de baixo risco de crédito.

Adequado  
Res. EAPC / EFPC

Status  
Aberto para Captação

## - Time de Crédito -

Alan Corrêa

Comitê de Crédito

Portfolio Manager

20 anos de carreira  
11 anos de Vanguarda  
Setor: Securitização

Antonio Corrêa

Comitê de Crédito

Portfolio Manager

13 anos de carreira  
10 anos de Vanguarda  
Setores: Bens de Capital e Infra

Marco Antônio Pereira

Comitê de Crédito

Analista

45 anos de carreira  
21 anos de Vanguarda  
Setor: Instituições Financeiras

Gustavo Moraes

Comitê de Crédito

Analista

7 anos de carreira  
7 anos de Vanguarda  
Setores: Aluguel de Veículos, Logística,  
Resíduos e Saneamento

Cesar Henrique Santos

Analista

17 anos de carreira  
1 ano de Vanguarda  
Setores: Concessões Rodoviárias e  
Varejo

Daniel Tavares

Analista

14 anos de carreira  
1 ano de Vanguarda  
Setores: Oil& Gas, Saúde e Telecom

Lisa Albaneze

Analista

4 anos de carreira  
4 anos de Vanguarda  
Setor: Elétrico

Henrique Bianchini

Gerencial

10 anos de carreira  
5 anos de Vanguarda

Diego Vaz

Tecnologia

12 anos de carreira  
2 anos de Vanguarda  
Análise de dados e BI

Gabriel Izoton

Tecnologia

6 anos de carreira  
1 ano de Vanguarda  
Desenvolvedor

Andre Souza

Tecnologia

5 anos de carreira  
1 ano de Vanguarda  
Análise de dados e BI

Valentina Olivetto

Estagiária

Gustavo Medeiros

Estagiário

## - Outros Contribuidores -

Bernardo Schneider

Comitê de Crédito

CEO

20 anos de carreira  
20 anos de Vanguarda

Frederico Cunha

Portfolio Manager Imobiliário

25 anos de carreira  
3 anos de Vanguarda

Marcus Valpassos

Portfolio Manager Imobiliário

20 anos de carreira  
3 anos de Vanguarda

Larissa Gontijo

Compliance

10 anos de carreira  
8 anos de Vanguarda