

ICATU VANGUARDA DINÂMICO FIM

(Dezembro/2024)

ICATU | VANGUARDA

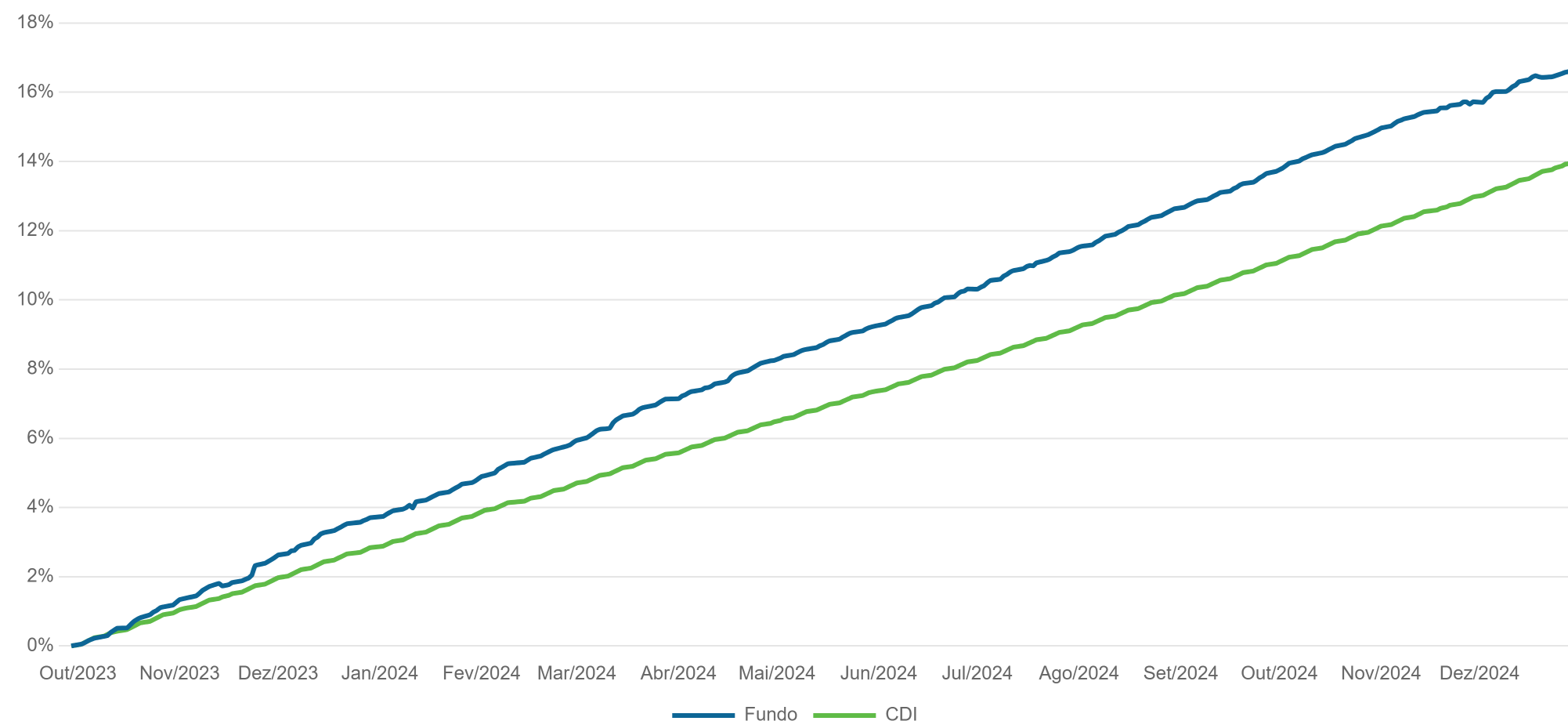
O objetivo deste fundo é gerar retornos de 1,00% a 2,00% acima do CDI no médio e longo prazo, com volatilidade controlada, por meio de investimentos em mercados descorrelacionados. A estratégia combina alocações em crédito privado – limitado a 50% do patrimônio – e renda variável, através de uma carteira diversificada que inclui ações, operações de arbitragem e estratégias de volatilidade. O portfólio é construído com foco em ativos de baixo risco de crédito e possibilita estruturas de investimento com proteção, maximizando as oportunidades de retorno.

Status



Aberto para Captação

Retorno Acumulado



Características

CNPJ	52.163.627/0001-67
Administrador	BEM DTVM
Custodiante	BRADESCO
Início	29/09/2023
Benchmark	CDI
PL Atual	R\$ 322.315.732
PL Médio (12m)	R\$ 119.544.261
Taxa de Administração	0,45% (máx. 1,00%) a.a.
Taxa de Performance	20% s/ 100% do CDI
Periodicidade	Semestral
Aplicação Inicial Mínima	R\$ 500
Movimentação Mínima	R\$ 500
Saldo Mínimo	R\$ 500
Aplicações (Cotização/Liquidação)	D+0 / D+0
Resgates (Cotização/Liquidação)	D+9 / DU+1 (da cotização)

Desempenho	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	36 Meses	Desde Início
Retorno Fundo	0,83%	12,52%	12,52%	-	-	16,69%
CDI	0,93%	10,87%	10,87%	-	-	14,02%
CDI+	-0,10%	1,48%	1,48%	-	-	2,34%
CDI+ (Anualizado)	-1,15%	1,48%	1,48%	-	-	1,87%
% CDI	89,54%	115,12%	115,12%	-	-	119,01%


Carteira de Crédito	Out-24	Nov-24	Dez-24
%PL Investido	27,72%	32,07%	27,94%
Spread de Crédito	1,83%	1,85%	1,97%
Duration	2,48	2,54	2,55
Número de Emissores	100	100	98
%PL Médio por Emissor	0,28%	0,32%	0,29%
Maior Emissor	1,90%	1,89%	1,62%

ICATU VANGUARDA DINÂMICO FIM

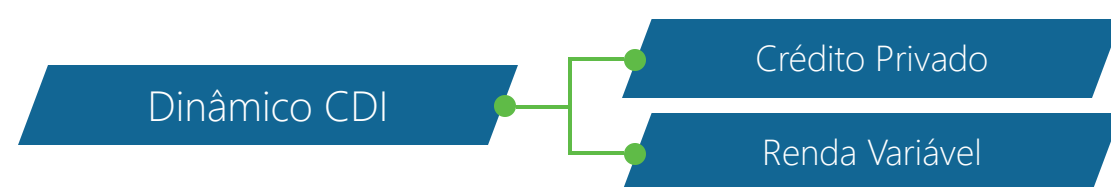
(Dezembro/2024)

ICATU | VANGUARDA

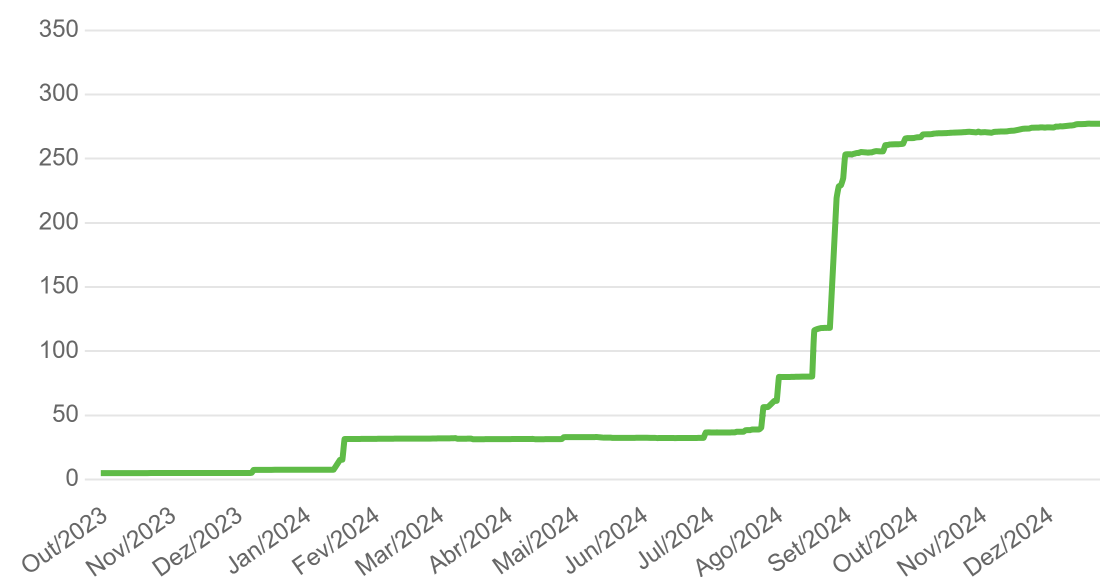
O objetivo deste fundo é gerar retornos de 1,00% a 2,00% acima do CDI no médio e longo prazo, com volatilidade controlada, por meio de investimentos em mercados desconcorrelacionados. A estratégia combina alocações em crédito privado – limitado a 50% do patrimônio – e renda variável, através de uma carteira diversificada que inclui ações, operações de arbitragem e estratégias de volatilidade. O portfólio é construído com foco em ativos de baixo risco de crédito e possibilita estruturas de investimento com proteção, maximizando as oportunidades de retorno.

Status
 **Aberto para Captação**

Mercado de Atuação



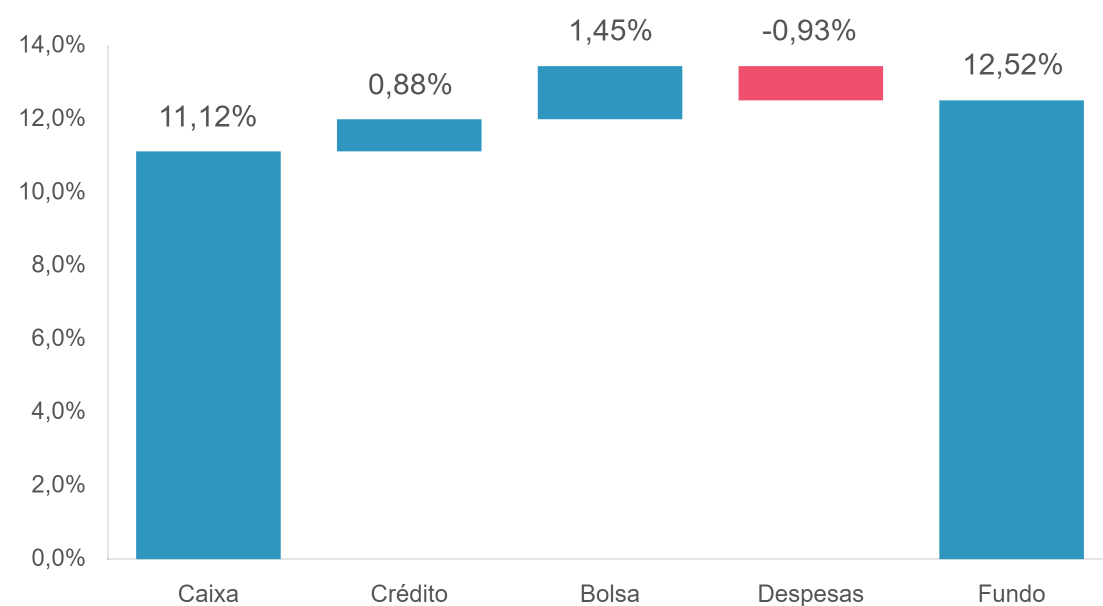
Evolução AuM (R\$ Milhões)



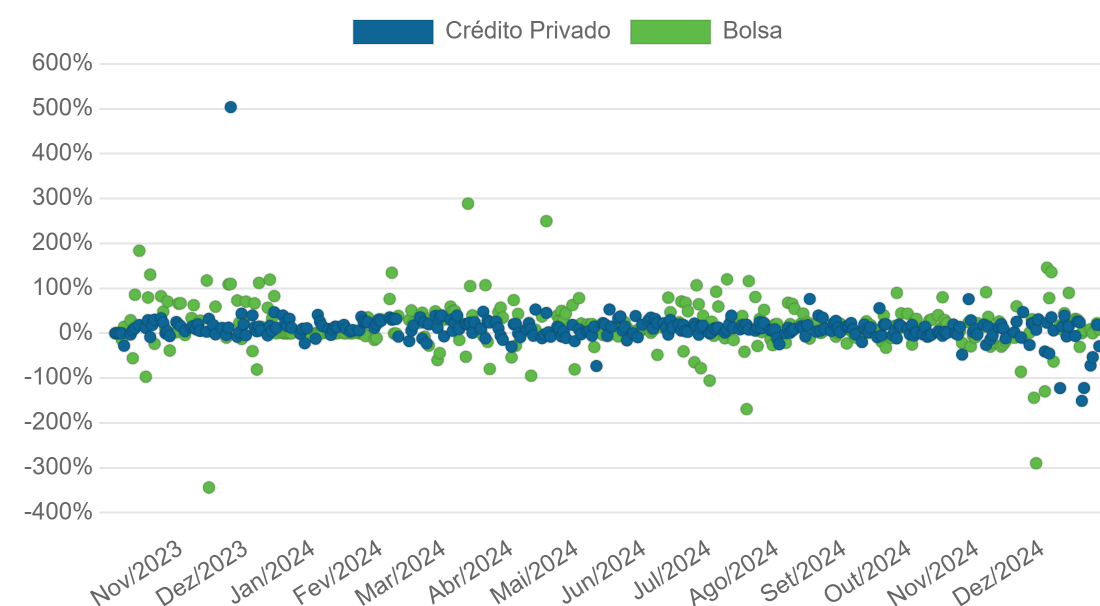
Estatísticas

Descrição	Estatística
Nº Meses > 0	15 (94%)
Nº Meses < 0	0 (0%)
Nº Meses > Benchmark	13 (81%)
Nº Meses < Benchmark	3 (19%)
Maior Rentabilidade Mensal	1,28% (nov/23)
Menor Rentabilidade Mensal	0,00% (set/23)
Maximum Drawdown	-0,1%
Volatilidade Diária a.a. (12M)	0,4%

PnL Ano




PnL Diário (%CDI)



Correlação Alfa (% CDI) - Crédito vs Bolsa (1 mês rolling)



O objetivo deste fundo é gerar retornos de 1,00% a 2,00% acima do CDI no médio e longo prazo, com volatilidade controlada, por meio de investimentos em mercados descorrelacionados. A estratégia combina alocações em crédito privado – limitado a 50% do patrimônio – e renda variável, através de uma carteira diversificada que inclui ações, operações de arbitragem e estratégias de volatilidade. O portfólio é construído com foco em ativos de baixo risco de crédito e possibilita estruturas de investimento com proteção, maximizando as oportunidades de retorno.

Status
 **Aberto para Captação**

- Times Envolvidos -

Crédito Privado

Antonio Corrêa

Portfolio Manager

13 anos de carreira

10 anos de Vanguarda

Alan Corrêa

Portfolio Manager

20 anos de carreira

11 anos de Vanguarda

Marco Antônio Pereira

Analista de Crédito

45 anos de carreira

21 anos de Vanguarda

+8 Analistas

9 anos de carreira (média)

3 anos de Vanguarda (média)

Renda Variável

Luiz Fernando Missagia

Portfolio Manager

27 anos de carreira

3 anos de Vanguarda

Marcio Luis

Head de Análise

22 anos de carreira

16 anos de Vanguarda

+4 Analistas

6 anos de carreira (média)

2 anos de Vanguarda (média)