

ICATU VANGUARDA TOTAL RETURN CP INSTITUCIONAL FIRF LP

(Novembro/2024)

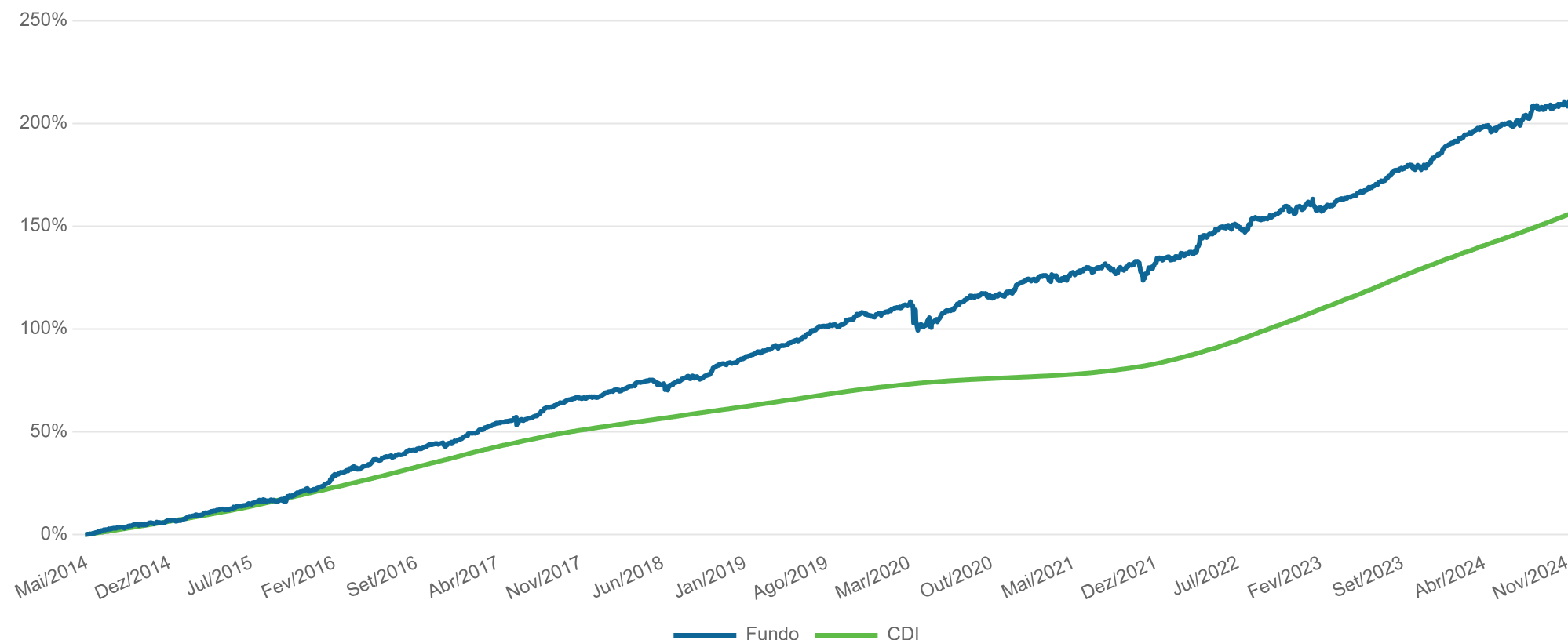
ICATU | VANGUARDA

Adaptado à resolução 4.994 do Banco Central, o produto busca gerar retornos acima da inflação nos médio e longo prazos através do investimento em uma carteira de crédito diversificada e focada em ativos de baixo risco de crédito. Além disso, o fundo possui uma carteira de risco de mercado focada nas curvas de juros nominal e real.

Adequado
Res. EFPC

Status
Aberto para Captação

Retorno Acumulado



O Fundo ICATU VANGUARDA TOTAL RETURN CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FIRF LP – CNPJ: 44.212.261/0001-40 iniciou suas atividades em 25/04/2014 com recursos provenientes da cisão parcial do Fundo ICATU VANGUARDA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO – CNPJ/ME 19.719.727/0001-51.

Características

CNPJ	44.212.261/0001-40
Administrador	BEM DTVM
Custodiante	BRABESCO
Início	19/04/2022
Benchmark	CDI
PL Atual	R\$ 36.545.443
PL Médio (12m)	R\$ 224.622.792
Taxa de Administração	0,45%
Taxa de Performance	20% s/ 100% do CDI
Periodicidade	Anual
Aplicação Inicial Mínima	R\$ 500
Movimentação Mínima	R\$ 500
Saldo Mínimo	R\$ 500
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	-0,2%	6,6%	8,5%	19,2%	32,8%	209,0%
CDI	0,8%	9,9%	10,8%	25,6%	40,6%	157,5%
CDI+	-0,9%	-2,9%	-2,1%	-5,1%	-5,5%	20,0%
CDI+ (Anualizado)	-11,7%	-3,2%	-2,1%	-2,6%	-1,9%	1,7%
% CDI	-19,2%	67,5%	78,4%	75,2%	80,9%	132,6%

Carteira de Crédito	Set-24	Out-24	Nov-24
%PL Investido	80,81%	78,35%	69,76%
Spread de Crédito	1,73%	1,72%	3,34%
Duration	3,22	3,17	3,49
Número de Emissores	107	104	59
%PL Médio por Emissor	0,76%	0,76%	1,18%
Maior Emissor	3,15%	3,18%	6,27%

ICATU VANGUARDA TOTAL RETURN CP INSTITUCIONAL FIRF LP

(Novembro/2024)

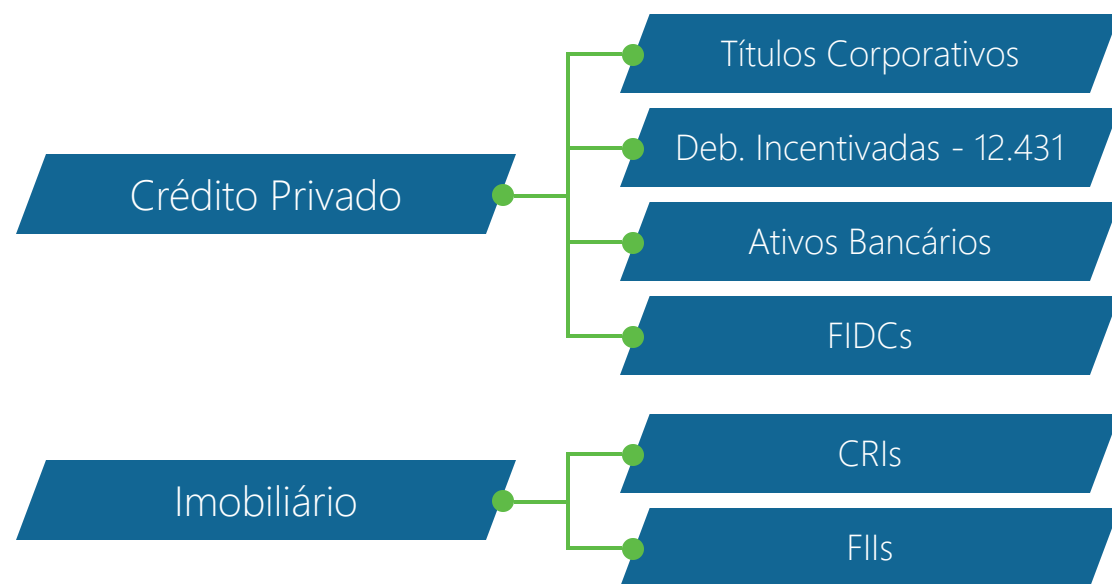
ICATU | VANGUARDA

Adaptado à resolução 4.994 do Banco Central, o produto busca gerar retornos acima da inflação nos médio e longo prazos através do investimento em uma carteira de crédito diversificada e focada em ativos de baixo risco de crédito. Além disso, o fundo possui uma carteira de risco de mercado focada nas curvas de juros nominal e real.

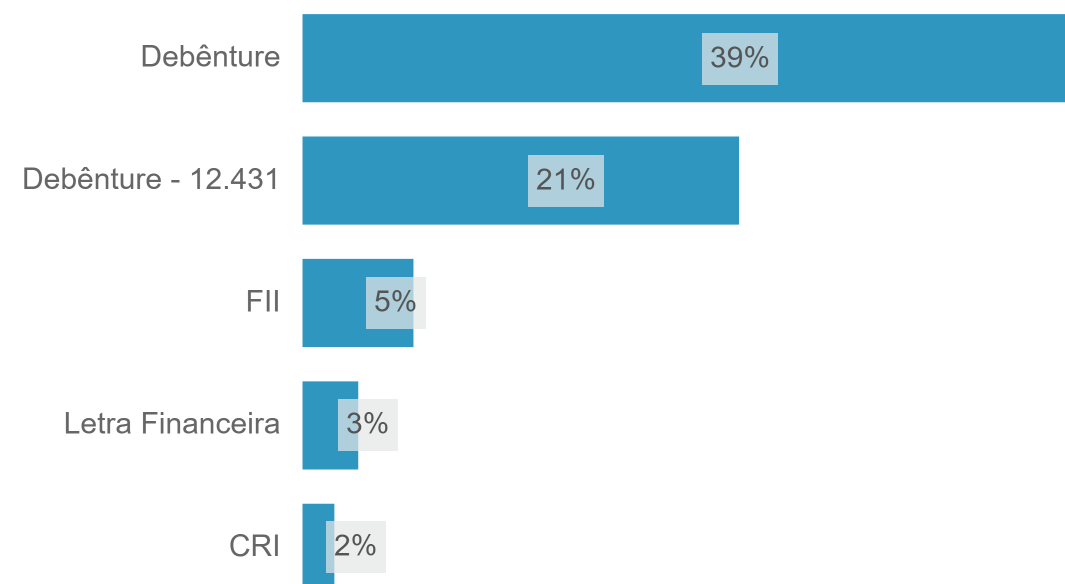
Adequado
Res. EFPC

Status
Aberto para Captação

Mercado de Atuação



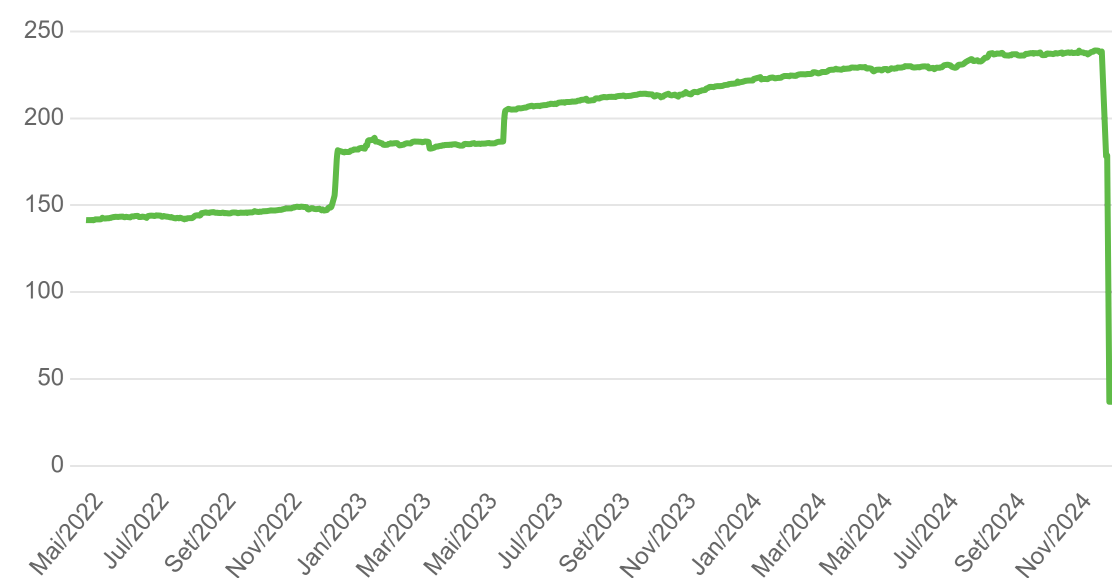
Alocação



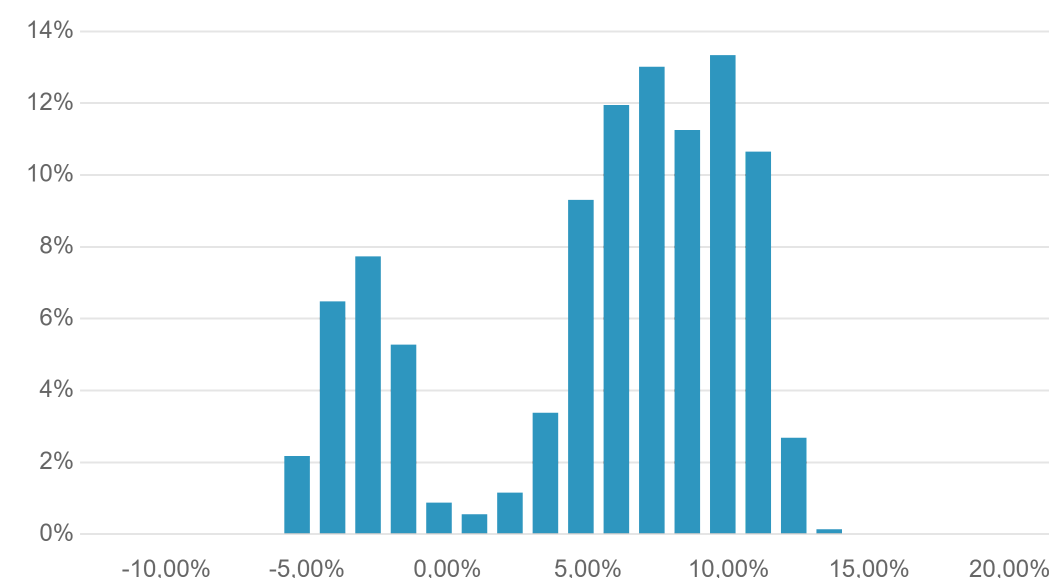
Estatísticas

Descrição	Estatística
Nº Meses > 0	112 (88%)
Nº Meses < 0	16 (12%)
Nº Meses > Benchmark	75 (59%)
Nº Meses < Benchmark	53 (41%)
Maior Rentabilidade Mensal	4,07% (jan/16)
Menor Rentabilidade Mensal	-4,41% (mar/20)
Maximum Drawdown	-6,5%
Volatilidade Diária a.a. (12M)	2,7%

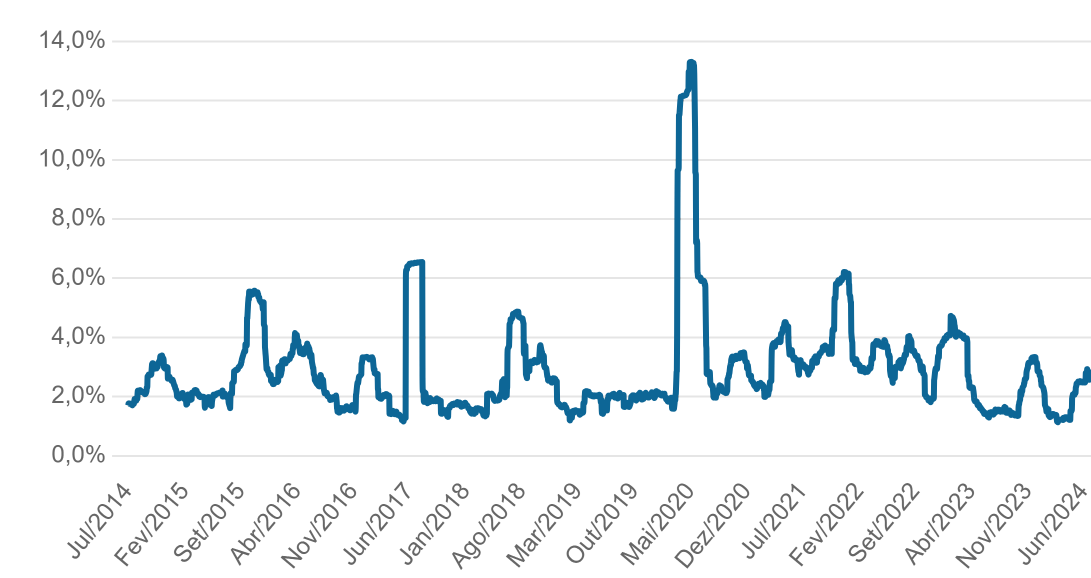
Evolução AuM (R\$ Milhões)




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




Evolução da Volatilidade (44du Anualizada)



Adaptado à resolução 4.994 do Banco Central, o produto busca gerar retornos acima da inflação nos médio e longo prazos através do investimento em uma carteira de crédito diversificada e focada em ativos de baixo risco de crédito. Além disso, o fundo possui uma carteira de risco de mercado focada nas curvas de juros nominal e real.

Adequado
 Res. EFPC

Status
 Aberto para Captação

- Time de Crédito -

- Outros Contribuidores -

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

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