

Informações Gerais

Público Alvo	Investidores em geral
Classificação ANBIMA	RF Duração Alta Grau de Inv.
CNPJ	10.756.541/0001-06
Código ANBIMA	244953
Gestor	Icatu Vanguarda Gestão de Recursos
Administrador	BEM DTM
Custodiante	Banco Bradesco S/A
Auditor Independente	EY
Lançamento	26/06/2009
Benchmark	IMA-B 5+
PL Atual	R\$ 680.632.683
PL Médio (12m)	R\$ 873.319.204
Taxa de Administração	0,250% a.a.
Taxa de Performance	-
Tipo de Cota	Fechamento
Aplicação Mínima Inicial*	R\$ 1.000.000,00
Movimentação Mínima*	Não há
Saldo Mínimo Permanência*	R\$ 1.000.000,00
Horário de Movimentação*	Até as 14h
Aplicações (dias úteis)	Depósito em D+0 Cota em D+0
Resgate (dias úteis)	Cota em D+0 Pagamento em D+1
Tributação	IR Alíquota 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 Alíquota regressiva sobre o rendimento de aplicações de prazo inferior a 30 dias.
Dados para Aplicação:	Banco 237 Agência 2856-8 Conta Corrente Favorecido 612857-2

Descrição

Fundo que investe predominantemente em NTN's, porém com vencimentos mais longos. Trata-se de um fundo para investidores que desejam "perpetuar" a taxa de juros real do Brasil. Como a duration da carteira é bastante elevada, sempre superior a 10 anos, o fundo possui uma volatilidade elevada devido a marcação a mercado dos títulos. Logo, o horizonte de retorno deste fundo deverá ser de longo prazo. Se você acredita que no futuro de médio/longo prazo o Brasil irá operar com juros reais em níveis mais baixos (parecido com juros praticados por países desenvolvidos), este será o produto/ativo que mais se beneficiará na concretização deste movimento.

Tabela de Rentabilidades¹

	2021		2020		2019		2018	
	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+
janeiro	-1,73%	-1,69%	0,02%	0,03%	6,58%	6,61%	4,97%	4,95%
fevereiro	-2,35%	-2,33%	0,28%	0,32%	0,52%	0,55%	0,56%	0,56%
março	-1,22%	-1,17%	-11,01%	-10,93%	0,38%	0,43%	0,38%	0,38%
abril	0,43%	0,45%	1,99%	2,01%	1,75%	1,79%	-0,66%	-0,63%
maio	1,35%	1,38%	0,99%	1,02%	5,14%	5,20%	-4,73%	-4,65%
junho	0,82%	0,83%	2,78%	2,84%	5,04%	5,06%	-1,12%	-1,08%
julho	-0,81%	-0,76%	7,35%	7,32%	1,44%	1,51%	3,12%	3,15%
agosto	-2,31%	-2,22%	-3,66%	-3,62%	-0,81%	-0,77%	-0,52%	-0,52%
setembro	-1,34%	-1,26%	-2,62%	-2,60%	3,73%	3,73%	-1,08%	-1,03%
outubro	-3,87%	-3,87%	0,19%	0,22%	4,71%	4,67%	10,69%	10,66%
novembro			2,55%	2,59%	-4,14%	-4,07%	1,53%	1,52%
dezembro			7,50%	7,51%	2,60%	2,60%	1,85%	1,88%

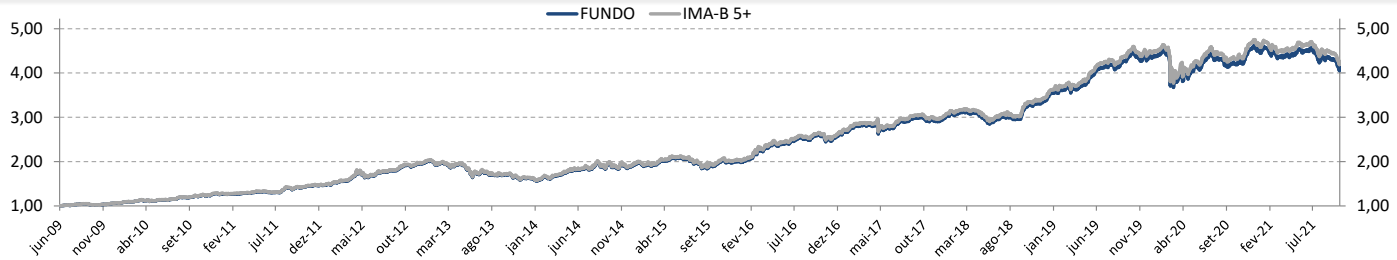
	2021		2020		2019		2018	
	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+
Acum Ano	-10,58%	-10,25%	5,10%	5,50%	29,93%	30,37%	15,17%	15,41%
Acum Início	312,44%	326,02%	361,24%	374,66%	338,87%	349,93%	237,78%	245,12%

	6 meses		12 meses		24 meses		36 meses	
	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+	Fundo	IMA-B 5+
Retornos	-6,08%	-5,85%	-1,41%	-1,01%	-7,57%	-6,80%	26,26%	27,68%

Nível de Risco



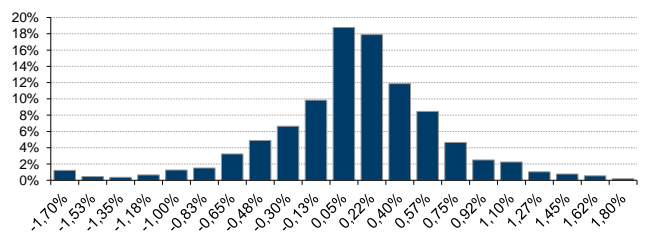
Rentabilidade Acumulada x IMA-B 5+



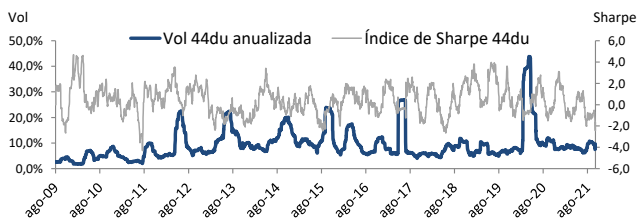
Estatísticas de 2018 a 2021

Descrição	Estatísticas
Nº Meses >0	29 (63%)
Nº Meses <0	17 (37%)
Nº Meses >Benchmark	8 (17%)
Nº Meses <Benchmark	38 (83%)
Maior Rentabilidade Mensal	10,69% - 10/2018
Menor Rentabilidade Mensal	-11,01% - 03/2020
Maximum Drawdown ¹	-22,82%
Volatilidade Diária a.a. (12m)	8,70%
Índice de Sharpe (12m)	-0,56

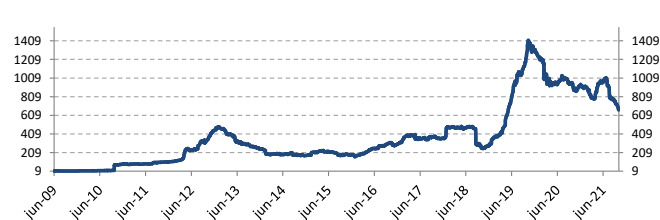
Histograma de Retornos



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. Para mais informações, visite nosso site: 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.

