

OBJETIVO DO FUNDO

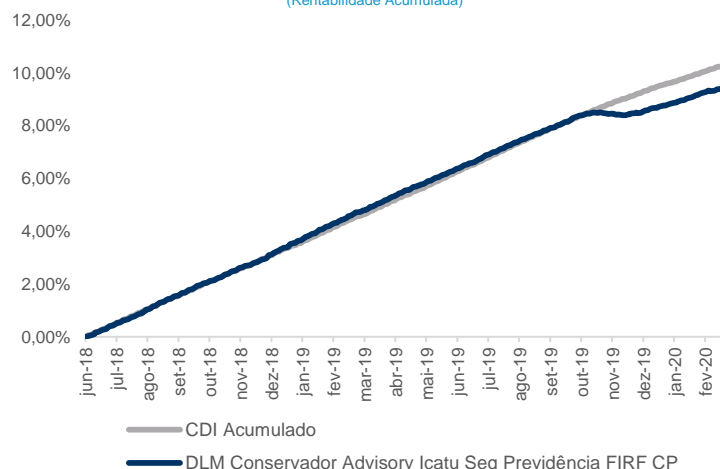
O FUNDO busca proporcionar ganhos de capital superiores ao rendimento do CDI no longo prazo.

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

A política de investimento do FUNDO consiste em alocações em títulos públicos e privados, com o objetivo de proporcionar ganhos de capital superiores ao rendimento do CDI no longo prazo.

COMPARATIVO DE PERFORMANCE

(Rentabilidade Acumulada)


RENTABILIDADE MENSAL 2020

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM. ¹
Fundo	0,38%	0,22%											0,59%	9,48%
2020 CDI	0,38%	0,29%											0,67%	10,36%
%CDI	100,10%	73,66%											88,47%	91,52%

RENTABILIDADE MENSAL DESDE O INÍCIO (Início em 13/06/2018)

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM. ¹
2019 Fundo	0,59%	0,50%	0,47%	0,53%	0,50%	0,43%	0,56%	0,46%	0,48%	0,12%	0,02%	0,33%	5,11%	8,84%
%CDI	108,44%	102,25%	99,50%	101,87%	91,83%	92,71%	99,27%	91,65%	103,52%	24,00%	5,03%	88,82%	85,66%	91,80%
2018 Fundo						0,27%	0,53%	0,62%	0,49%	0,52%	0,46%	0,61%	3,54%	3,54%
%CDI						90,06%	97,35%	109,90%	105,23%	95,34%	92,59%	123,10%	102,65%	102,65%

RENTABILIDADE

	Fundo	% CDI
Acumulada desde o início	9,48%	91,52%
Últimos 12 meses	4,59%	82,22%
Últimos 24 meses	-	-
Últimos 36 meses	-	-

ANÁLISE ESTATÍSTICA

Patrimônio Atual	R\$ 38.339.930,06
Patrimônio Médio*	R\$ 42.055.995,52
Nº de meses acima do CDI	8
Nº de meses abaixo do CDI	13
Nº de meses positivos	21
Nº de meses negativos	0
Maior retorno mensal	0,62%
Menor retorno mensal	0,02%

* Últimos 12 meses

MEDIDAS DE RISCO*

Var	0,08%
Volatilidade	0,17%
Índice de Sharpe	-5,43

* Últimos 12 meses

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA ATUAL

CDB	0%
Letras Financeiras	14%
Debêntures	50%
Operações Estruturadas	0%
FIDC	7%
Caixa	29%

DISTRIBUIÇÃO POR RATING

BBB	0%
A	6%
AA	58%
AAA	36%

DISTRIBUIÇÃO POR SETOR

Bens de Capital	0,00%
Concessões	5,98%
Consumo cíclico	4,32%
Consumo não cíclico	4,33%
Educação	3,00%
Energia	11,35%
FIDC	6,76%
Imobiliário	3,04%
Locação de Veículos	8,62%
Papel / Celulose	0,67%
Petroquímico	3,11%
Setor Financeiro	14,33%
Saneamento	2,61%
Saúde	1,49%
Telecom	1,03%
TOTAL EM CRÉDITO PRIVADO	70,63%

CARACTERÍSTICAS
Fundo: DLM Conservador Advisory Icatu Seg Previdência Fundo de Investimento RF Crédito Privado

Gestão: DLM Invista Gestão de Recursos LTDA

Administração: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S/A

Custódia: BNY Mellon Banco S.A.

Benchmark: CDI

Classificação Anbima: Previdência Renda Fixa

Código Anbima: 474241

Bloomberg: DMCAISP <BZ> <Equity>

Taxa de Administração: 0.80% a.a.²
Taxa de Performance: Não há

Carência: não possui prazo de carência

Cota de Aplicação: D+0 (cota do dia, desde a disponibilidade dos recursos)

Cota de Resgate: D+3 (três dias úteis após a solicitação do resgate)

Liquidação do Resgate: D+1 (um dia útil após a data de cotização)

Auditoria: KPMG Auditores Independentes S/A

Signatory of:



¹Rentabilidade acumulada desde o início do FUNDO. ²A taxa de administração prevista é a taxa de administração mínima do FUNDO. Tendo em vista que o FUNDO admite a aplicação em cotas de fundos de investimento, fica estabelecida a taxa de administração máxima de 0.90% a.a. sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO, a qual compreende a taxa de administração mínima e a taxa de administração dos fundos nos quais o FUNDO investiu ("Taxa de Administração Máxima").

Público Alvo do fundo citado acima: O FUNDO destina-se exclusivamente a receber diretamente, recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre - PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre - VGBL (conjuntamente os "Planos") instituídos pela Icatu Seguros S.A. doravante designado "COTISTA" ou "INSTITUIDORA", Investidor Profissional nos termos da Instrução CVM nº 539, de 13 de novembro de 2013 ("ICVM 539/13") e posteriores alterações. Pretende-se com este relatório de desempenho apenas divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela DLM Invista Gestão de Recursos LTDA, não significando oferta de venda do DLM Conservador Advisory Icatu Seg Previdência Fundo de Investimento RF Crédito Privado. Leia o formulário de informações complementares e o regulamento antes de investir. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os indicadores econômicos são meras referências econômicas, e não metas ou parâmetros de performance. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Este fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. O fundo pode estar exposto à significativa concentração em ativos financeiros de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo 12 (doze) meses.

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. (CNPJ: 02.201.501/0001-61). Av. Presidente Wilson, 231, 11º andar, Rio de Janeiro, RJ, CEP: 20.030-905. Telefone: (21) 3219-2500 / Fax (21) 3219-2501 / www.bnymellon.com.br/sf - SAC: sac@bnymellon.com.br ou (21) 3219-2600, (11) 3050-8010 / Ouvidoria: ouvidoria@bnymellon.com.br ou 0800 725 3219. Todos os documentos, como Regulamento, o Formulário de Informações Complementares podem ser encontrados em www.dlminvista.com.br Supervisão e fiscalização - Comissão de Valores Mobiliários (CVM) / Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.