

OBJETIVO DO FUNDO

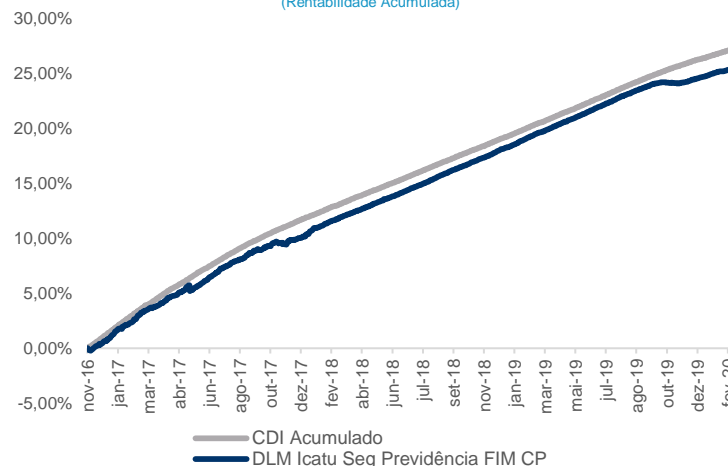
O FUNDO busca proporcionar ganhos de capital superiores ao rendimento do CDI.

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O FUNDO busca proporcionar ao cotista rentabilidade através de aplicação de recursos em carteira diversificada de títulos, valores mobiliários, ativos financeiros e modalidades operacionais disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, sem o compromisso de concentração em nenhum fator de risco em especial, subordinando-se aos requisitos de composição e diversificação estabelecidos neste regulamento e na regulamentação em vigor aplicável ao FUNDO.

COMPARATIVO DE PERFORMANCE

(Rentabilidade Acumulada)


RENTABILIDADE MENSAL 2020

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM. ¹
Fundo	0,40%	0,19%											0,59%	25,42%
CDI	0,38%	0,29%											0,67%	27,21%
%CDI	106,07%	63,40%											87,31%	93,40%

RENTABILIDADE MENSAL DESDE O INÍCIO (Início em 08/11/2016)

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM. ¹
2019 Fundo	0,58%	0,54%	0,49%	0,54%	0,56%	0,50%	0,61%	0,49%	0,46%	0,11%	0,05%	0,37%	5,43%	24,69%
2019 %CDI	107,61%	110,42%	103,89%	104,39%	102,56%	105,85%	107,74%	97,06%	97,91%	22,56%	13,78%	99,26%	91,00%	93,63%
2018 Fundo	0,70%	0,51%	0,51%	0,56%	0,52%	0,55%	0,54%	0,64%	0,50%	0,57%	0,51%	0,56%	6,88%	18,26%
2018 %CDI	120,76%	110,19%	95,35%	107,69%	100,91%	106,67%	98,82%	113,67%	106,02%	105,20%	102,58%	113,77%	107,12%	94,89%
2017 Fundo	0,85%	1,01%	0,81%	0,77%	0,49%	1,02%	0,84%	0,77%	0,52%	0,53%	0,28%	0,73%	8,97%	10,65%
2017 %CDI	78,09%	116,81%	76,64%	98,12%	53,15%	125,19%	105,45%	96,55%	80,84%	81,79%	49,68%	134,61%	90,11%	88,38%
2016 Fundo											0,39%	1,15%	1,54%	1,54%
2016 %CDI											50,31%	102,30%	80,90%	80,90%

RENTABILIDADE

	Fundo	% CDI
Acumulada desde o início	25,42%	93,40%
Últimos 12 meses	4,86%	87,09%
Últimos 24 meses	11,98%	96,99%
Últimos 36 meses	21,24%	94,72%

ANÁLISE ESTATÍSTICA

Patrimônio Atual	R\$ 76.305.741,75
Patrimônio Médio*	R\$ 77.200.192,47
Nº de meses acima do CDI	23
Nº de meses abaixo do CDI	17
Nº de meses positivos	40
Nº de meses negativos	0
Maior retorno mensal	1,15%
Menor retorno mensal	0,05%

* Últimos 12 meses

MEDIDAS DE RISCO*

Var	0,08%
Volatilidade	0,17%
Índice de Sharpe	-4,14

* Últimos 12 meses

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA ATUAL

CDB	0%
Letras Financeiras	11%
Debêntures	52%
Operações Estruturadas	0%
FIDC	7%
Caixa	30%

DISTRIBUIÇÃO POR RATING

BBB	0%
A	9%
AA	54%
AAA	37%

DISTRIBUIÇÃO POR SETOR

Bens de Capital	0,22%
Concessões	6,94%
Consumo cíclico	3,29%
Consumo não cíclico	2,76%
Educação	4,66%
Energia	14,57%
FIDC	6,51%
Imobiliário	6,50%
Locação de Veículos	6,83%
Papel / Celulose	0,66%
Petroquímico	2,52%
Setor Financeiro	10,83%
Saneamento	1,35%
Saúde	1,68%
Telecom	0,90%
TOTAL EM CRÉDITO PRIVADO	70,22%

CARACTERÍSTICAS
Fundo: DLM Icatu Seg Previdência Fundo de Investimento Multimercado Crédito Privado

Gestão: DLM Invista Gestão de Recursos LTDA

Administração: BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.

Custódia: Banco Bradesco S.A.

Benchmark: CDI

Classificação Anbima: Previdência Multimercados

Código Anbima: 428159

Bloomberg: DLMISPV <BZ> <Equity>

Taxa de Administração: 0.80% a.a.

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+1 (um dia útil após a solicitação do resgate)

Liquidação do Resgate: D+2 (dois dias úteis após a data de cotização)

Auditoria: KPMG Auditores Independentes S/A

Signatory of


¹ Rentabilidade acumulada desde o início do FUNDO.

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 Icatu Seg Previdência Fundo de Investimento Multimercado 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: BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ: 00.066.670/0001-00). Cidade de Deus, Prédio Prata, 4o andar, Vila Yara, Osasco, SP. Telefone: (11) 3684-9432 / Site: www.bradescobemdtvm.com.br / E-mail: centralbemdtvm@bradesco.com.br. Todos os documentos, como Regulamento, o Formulário de Informações Complementares podem ser encontrados em www.dlminvesta.com.br. Supervisão e fiscalização - Comissão de Valores Mobiliários (CVM) / Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.