

CNPJ
46.329.038/0001-03

Nome do fundo
ASA HEDGE FIE ICATU CIC DE CLASSE DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO - RESP LIMITADA

Gestor
ASA ASSET 2 GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Administrador
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

Custodiante
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

Auditor independente
ERNST & YOUNG AUDITORES INDEPENDENTES S/S LTDA.

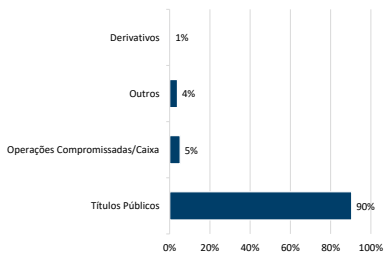
Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência Multimercados Livre
Classificação CVM Fundo Multimercado
Código Anbima C0000679607
Código ISIN BR00CGCTF000
Lançamento 11/11/2022
Benchmark CDI
Cota Fechamento
Depósito em D+0
Cota em D+0
Cota em D+3
Resgate (Dias úteis) Liquidação em D+4
Passagem de acordo com o prazo dos planos*
Mínima: 0,05%
Efetiva: 0,05%
Mínima: 0,00%
Taxa de administração Máxima: 2,20%
Efetiva: 0,05%
Taxa de performance Máxima: 20% do que excede 100% do CDI
Efetiva: 20% do que excede 100% do CDI

Objetivo do fundo
Produto previdenciário da estratégia ASA Hedge, observando os limites impostos pela regulamentação previdenciária, que busca geração de retornos identificando deslocamentos no plano macro global e local, e usando análise técnica para eleger ativos com melhor custo-benefício e calibrar posições, aumentando, assim, a eficiência do produto. O fundo atua nos mercados de juros, câmbio, ações e commodities, no Brasil e no exterior, utilizando-se dos instrumentos disponíveis nos mercados à vista e de derivativos, sem compromisso de aderência a qualquer ativo de risco em especial.

Indicadores Risco x Retorno			
Indicador	12 meses	Desde o início	
Nº Meses <0	5	15	
Nº Meses >0	7	15	
Nº Meses <Benchmark	11	25	
Nº Meses >Benchmark	1	5	
Mayor Rentabilidade Mensal	1,03%	2,33%	
Menor Rentabilidade Mensal	-1,56%	-3,96%	
Maximum Drawdown	9,92%	9,92%	
Volatilidade Anualizada	6,64%	5,73%	
Índice de Sharpe	-1,84	-4,26	

Rentabilidades Acumuladas			
Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	-0,87%	3,19%	-27,33%
Últimos 6 meses	1,64%	6,25%	26,31%
Últimos 12 meses	-0,44%	11,80%	-3,69%
Últimos 24 meses	-4,10%	25,21%	-16,25%
Últimos 36 meses			
Últimos 48 meses			
Últimos 60 meses			
Desde o início	-4,61%	34,23%	-13,47%

Composição da Carteira***



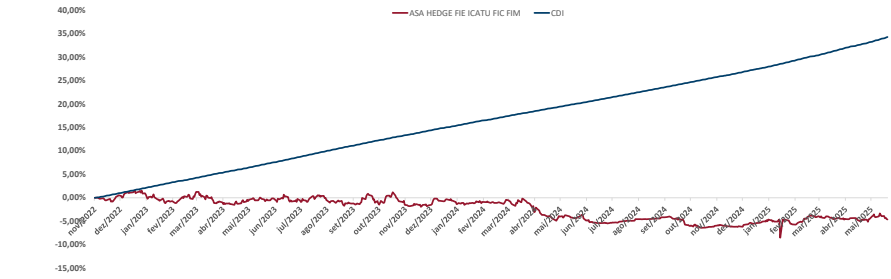
Data da carteira: jan/2025
***Número de aberturas consecutivas: 5



Público Alvo

O Fundo destina-se exclusivamente a receber, diretamente ou por meio dos seus Fundos de Investimento, recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre – PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre – VGBL (conjuntamente ao “Plano”), disciplinados pela Resolução do Conselho Monetário Nacional no 4.444 de 13.11.2015 (Res. CMN no 4.444/15), destinados a proponentes não qualificados, instituídos pela Icatu Seguros S.A., doravante designado Cotista ou Instituidor, Investidor Profissional nos termos da Instrução CVM no 539, de 13.11.2013 (ICVM 539/13) e posteriores alterações.

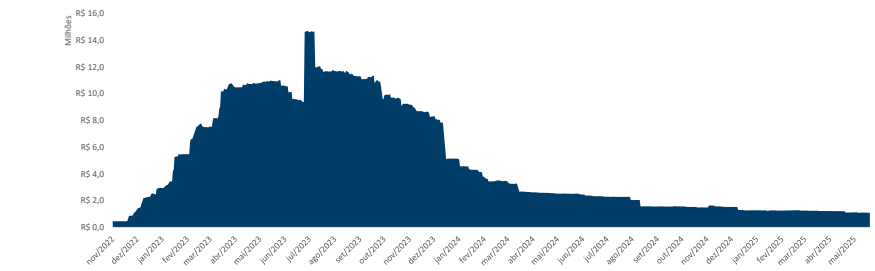
Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

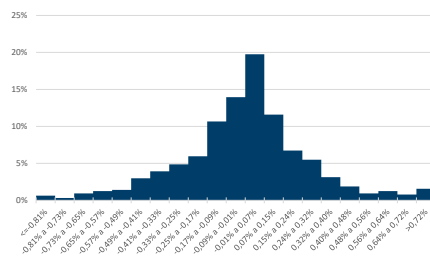
		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2021	Fundo														
	%CDI														
2022	Fundo											-0,82%	1,95%	1,11%	1,11%
	%CDI											0,61%	1,12%	1,74%	1,74%
2023	Fundo	-1,64%	0,82%	-1,36%	-0,19%	0,76%	-0,26%	1,35%	-2,24%	2,33%	-0,55%	-1,83%	1,52%	-1,41%	-0,31%
	%CDI	-1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,89%	1,00%	1,00%	1,00%
2024	Fundo	-146,32%	88,79%	-116,07%	-20,56%	68,08%	-24,00%	125,83%	-196,60%	239,78%	-55,61%	-200,02%	169,68%	-10,80%	-2,07%
	%CDI	-85,5%	0,19%	0,74%	-3,96%	-0,01%	-1,24%	0,49%	0,49%	-0,36%	-1,56%	0,13%	0,88%	-5,03%	-5,33%
2025	Fundo	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,84%	0,93%	0,79%	0,93%	10,88%	27,52%
	%CDI	-88,27%	23,17%	89,55%	-445,70%	-0,95%	-156,81%	53,82%	56,58%	-42,66%	-168,47%	16,87%	94,26%	-46,29%	-19,37%
2025	Fundo	0,61%	1,03%	-0,67%	-0,24%	0,03%								0,76%	-4,61%
	%CDI	1,01%	0,99%	0,96%	1,06%	1,14%								5,26%	34,23%
		60,01%	104,60%	-69,01%	-22,32%	2,39%								14,40%	-13,47%

Evolução do Patrimônio Líquido

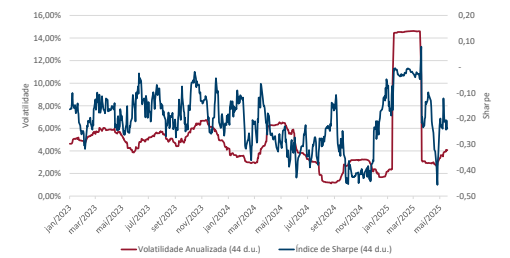


Patrimônio Líquido			
	Atual	R\$	1.096.647,52
	Médio nos últimos 12 meses	R\$	1.582.033,67
	Médio desde o início	R\$	4.889.996,72

Histograma dos Retornos Diários



Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe****



****Índice calculado a partir da razão entre a média do retorno diário acima do CDI e a volatilidade diária.

* De acordo com as Circulares SUSEP nº 563/564 de 2017, para planos destinados a proponentes varejo e qualificados aprovados a partir de 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é de até 10 (dez) dias úteis e 180 (cento e oitenta) dias úteis, respectivamente, e para planos anteriores a 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é até 5 (cinco) dias úteis. O crédito será efetuado pela Icatu Seguros até o prazo estipulado em norma, a contar do dia útil subsequente ao recebimento do formulário preenchido corretamente e mediante envio da documentação obrigatória solicitada. Os investimentos do Fundo estarão sujeitos a flutuações de mercado e a riscos de crédito. É importante ressaltar que, apesar do cuidado e diligência da Icatu Seguros no monitoramento de riscos do Fundo, sempre existe a possibilidade de oscilações superiores às estimativas utilizadas nos sistemas de controle, podendo ocasionar distúrbios e perdas superiores às esperadas. Desta forma, investimentos no Fundo devem ser sempre considerados como aplicações de risco, tendo em vista a possibilidade de não ser alcançado o objetivo de investimento a que o Fundo se propõe, bem como a possibilidade de perda parcial ou total dos recursos investidos. Investimentos em Fundos que podem sofrer perdas patrimoniais não são garantidos pela Instituição Administradora, pelo Gestor de Carteira nem por qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. É recomendada a leitura cuidadosa do formulário de informações complementares e do regulamento do fundo pelo investidor ao aplicar seus recursos, podendo este ser encontrado em <http://www.cvm.gov.br>. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. A descrição da classificação ANBIMA pode ser encontrada no formulário de informações complementares. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO: Comissão de Valores Mobiliários - CVM (Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br)