

Resumo da performance

57,35% do CDI

Mês

106,84% do CDI

Ano

106,84% do CDI

12 Meses

107,03% do CDI

Desde o início

Objetivos do Fundo

Fundo de crédito privado que busca superar o benchmark através de carteira diversificada de ativos de médio e baixo risco de crédito. Mandato amplo que reúne três importantes pilares de fontes de alfa: análise de crédito diferenciada com pesquisa e ratings proprietários, benefício de escala que permite um maior acesso às colocações exclusivas ("private placement") e gestão ativa em busca de arbitragens e constante renovação da carteira.

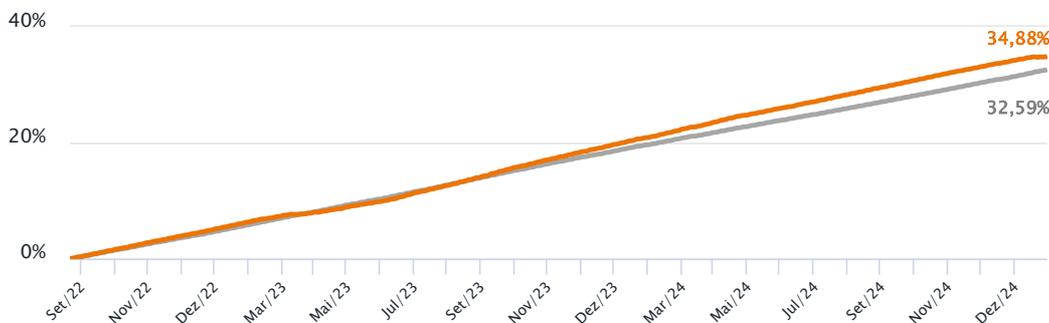
Termômetro de Risco



Retorno Acumulado

Data de início do fundo
22/07/2022

Itaú Prev High Yield CP MM Fie II Distr. ●
CDI ●



30 Meses desde o início do fundo



Meses em que esteve acima do benchmark



Meses de retorno positivo do fundo

0,21% Volatilidade 12 meses

Retorno Mensal

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2024	Fundo	1,17%	0,98%	1,01%	0,95%	0,90%	0,92%	1,00%	0,94%	0,92%	0,90%	0,81%	0,53%	11,62%
	CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	0,93%	0,79%	0,93%	10,87%
	%CDI	121,48%	122,46%	121,72%	107,15%	107,71%	116,61%	110,17%	108,38%	110,69%	96,81%	102,42%	57,35%	106,84%
2023	Fundo	1,01%	0,51%	0,91%	0,83%	1,30%	1,23%	1,25%	1,47%	1,13%	1,16%	1,10%	1,01%	13,71%
	CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%
	%CDI	90,14%	55,10%	77,69%	90,33%	115,87%	114,48%	116,89%	129,33%	116,43%	116,49%	119,64%	112,43%	105,06%
2022	Fundo	-	-	-	-	-	-	0,26%	1,25%	1,19%	1,10%	1,12%	1,19%	6,27%
	CDI	-	-	-	-	-	-	0,25%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	5,78%
	%CDI	-	-	-	-	-	-	107,49%	107,48%	111,10%	107,68%	109,36%	106,23%	108,50%

Retorno dos períodos

	Mês	Ano	12M	24M	36M	Desde o início
Fundo	0,53%	11,62%	11,62%	26,92%	-	34,88%
Benchmark	0,93%	10,87%	10,87%	25,34%	-	32,59%
% CDI	57,35%	106,84%	106,84%	106,22%	-	107,03%

Composição da Carteira

61,7% da carteira

% em Ativos de Crédito

Duration dos Créditos¹

3,1
em anos

(1) Sensibilidade (modified duration) da carteira de crédito ao spread

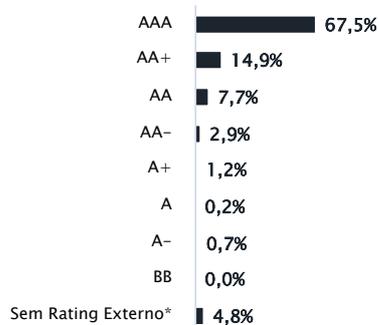
Debênture	39,31%
Compromissada	24,02%
LFT	14,30%
LF	13,74%
LF Subordinada Nível II	4,40%
FIDC	1,17%
LF Subordinada	1,08%
NC	0,84%
Bonds	0,69%
CRA	0,15%
CDB	0,14%
CRI	0,10%
DPGE	0,08%
Caixa e CPR	-0,03%

Defasagem da posição de crédito na carteira. Data base: 30 de Setembro de 2024

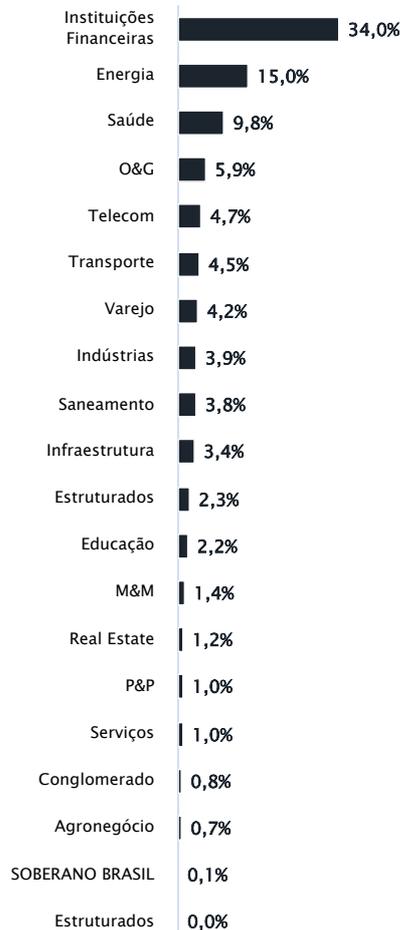
Posição de Crédito Privado

Visão Explodida

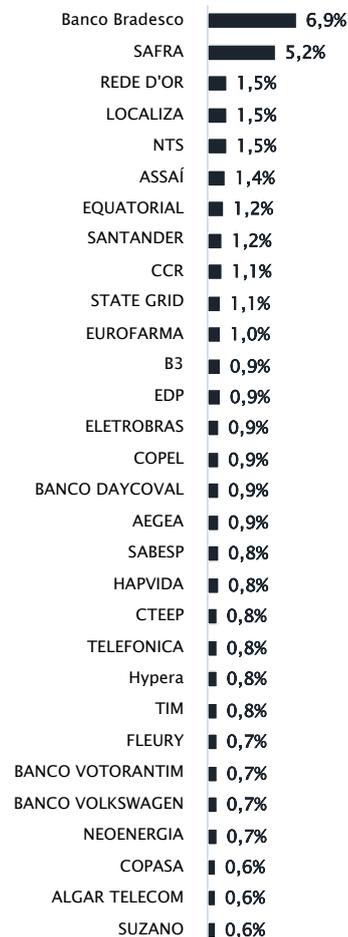
Rating Externo (% Crédito)



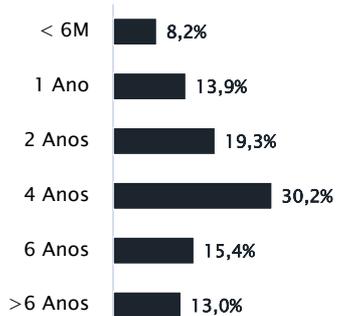
Sector (% Crédito)



TOP 30 Grupos Econômicos (% PL)



Fluxo dos Créditos (% Crédito)**



*Além dos ratings fornecidos pelas agências classificadores externas, todos os ativos de crédito possuem rating interno.
**Considera o valor presente dos fluxos de juros, amortizações e vencimentos dos ativos de crédito privado no fundo.

Características do produto

Este Material refere-se ao fundo investido pela Itaú Vida e Previdência S.A. para gestão das provisões dos planos.

Patrimônio Líquido Médio
Últimos 12 meses
R\$ 94.229.310,06

Taxa de Administração Cobrada
0,60% ao ano

Taxa de Administração Máxima
0,65% ao ano

Público Alvo
Previdenciário

Taxa de Performance
Não há

Processo SUSEP VGBl**

Processo SUSEP PGBl**

O fundo poderá, eventualmente, apresentar indisponibilidade, permanente ou temporária, de acesso por parte de investidores. Em caso de dúvidas, consulte seu gerente de relacionamento

Acesse outros documentos relevantes deste fundo: www.itaub.com.br/investimentos-previdencia/fundos/informacoes-cotistas/

Glossário: LF - Letra Financeira. CDB - Certificado de Depósito Bancário. LSF - Letra Financeira Subordinada. LFSN - Letra Financeira Elegível - Nível II. DEB - Debentures. NP - Notas Promissórias. CCB - Cédula de Crédito Bancário. FIDC - Fundo de Investimento em Direitos Creditórios. DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial. Debentures Conversível. Certificado de Recebíveis Imobiliários. LC - Letra de Câmbio. LCA - Letra de Crédito Agrícola. LCI - Letra de Crédito Imobiliário. DEB COMP - Debenture Compromissada. CDB Vinc - Certificado de Depósito Interbancário Vinculado. CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliário. CDCA - Certificado de Direitos Creditórios do Agronegócio. CPR - Contas a Pagar e Receber. DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial. COMPR - Operação Compromissada. LH - Letra Hipotecária. TERMO - Contrato a Termo



Signatory of:



Informações relevantes

ITAÚ PREV HIGH YIELD FIE II DISTRIBUIDORES FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO DA CLASSE DE INVESTIMENTO EM COTAS MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO - RESP LIM CNPJ 46.479.609/0001-96 - 31/12/2024

Este fundo é supervisionado e fiscalizado pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM (Serviço de atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br). Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Público alvo: O FUNDO destina-se a receber, com exclusividade, os recursos das provisões matemáticas e demais recursos e provisões de Planos Geradores de Benefícios Livre - PGBl e Vida Geradores de Benefícios Livre - VGBl, instituídos pela Itaú Vida e Previdência S.A., investidor profissional, nos termos da regulamentação em vigor. Objetivo do fundo: O objetivo do FUNDO é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem em ativos financeiros de diferentes naturezas, riscos e características, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial, observado que a rentabilidade do FUNDO será impactada em virtude dos custos e despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração. Tipo Anbima: PREVIDÊNCIA - MULTIMERCADOS LIVRE - Fundos nesta categoria se baseiam nas estratégias preponderantes adotadas e suportadas pelo processo de investimento adotado pelo gestor como forma de atingir os objetivos e executar a política de investimentos dos fundos. Livre é a estratégia na qual os fundos não possuem obrigatoriamente o compromisso de concentração em nenhuma estratégia específica. Início do fundo em: 22/07/2022. Taxa de Administração máx.: 0,65%. Taxa de Performance: Não há. Fonte de dados do material: Itaú Asset Management. Material de divulgação do fundo - A Itaú Asset Management é a gestora de fundos de investimentos do Itaú Unibanco. Leia a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Para obter mais informações, entre em contato pelo telefone 4004-4828. Consultas, sugestões, reclamações, críticas, elogios e denúncias, utilize o SAC: 0800 728 0728, todos os dias, 24 horas, ou o canal Fale Conosco (www.itaub.com.br). Se necessário contate a Ouvidoria Corporativa Itaú: 0800 570 0011 (em dias úteis das 9h às 18h) ou Caixa Postal 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, todos os dias, 24 horas, 0800 722 1722.

Confidencial | Externo