

CNPJ
16.687.215/0001-62

Nome do fundo
RIO GRANDE PREVIDENCIÁRIO II FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

Gestor
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Cogestor
RIO GRANDE SEGUROS E PREVIDÊNCIA S.A.

Administrador
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.

Custodiante
BANCO BRADESCO S.A.

Auditor independente
PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

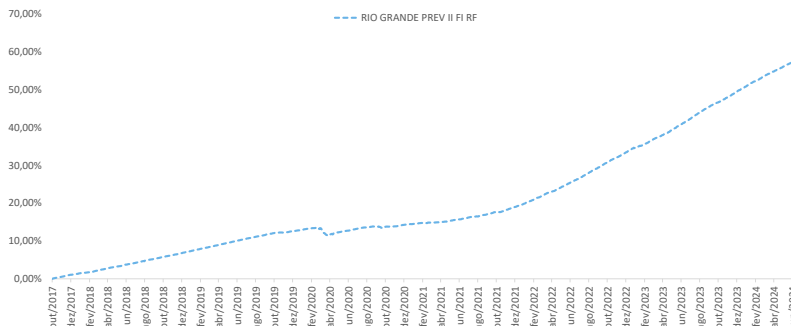
Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência RF Duração Baixa Crédito Liv
Classificação CVM Fundo de Renda Fixa
Código Anbima 333301
Código ISIN BRBRNR2CTFF003
Lançamento 16/10/2017
Benchmark Não há
Cota Fechamento
Aplicações Depósito em D+0
Cota em D+0
Resgate Cota em D+1
Liquidação em D+2
Pagamento em até D+10 (prazo dos planos)**
Taxa de administração Mínima: 0,70%
Máxima: 0,90%
Efetiva: 0,70%
Taxa de performance Mínima: Não há
Máxima: Não há
Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O FUNDO tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em ativos financeiros disponíveis no mercado financeiro e de capitais, relacionados direta, ou sintetizados via derivativos, à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços, nos termos deste regulamento e da regulamentação que disciplina a aplicação dos recursos das reservas, das provisões e dos fundos das sociedades seguradoras, das sociedades de capitalização e das entidades abertas de previdência complementar.

Público Alvo

O FUNDO destina-se a acolher as aplicações dos recursos de planos abertos de previdência complementar (PGBL) e de seguros de pessoas com cobertura por sobrevivência (VGBL), estruturados na modalidade de contribuição variável, tendo Rio Grande Seguros e Previdência S.A., CNPJ no 01.582.075/0001-90, investidor profissional de acordo com a Instrução CVM no 539, como único cotista do FUNDO.

Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2020	Fundo	0,38%	0,22%	-1,35%	0,15%	0,40%	0,39%	0,46%	0,23%	-0,07%	0,10%	0,19%	0,38%	1,48%	14,44%
	Benchmark														
	Dif.														
2021	Fundo	0,17%	0,09%	0,16%	0,16%	0,37%	0,35%	0,38%	0,39%	0,43%	0,29%	0,75%	0,74%	4,37%	19,44%
	Benchmark														
	Dif.														
2022	Fundo	0,76%	0,88%	0,99%	0,70%	1,06%	0,99%	0,98%	1,16%	1,08%	1,06%	0,93%	1,06%	12,29%	34,12%
	Benchmark														
	Dif.														
2023	Fundo	0,79%	0,67%	1,02%	0,75%	1,14%	1,07%	1,09%	1,17%	0,93%	0,78%	0,97%	0,94%	11,92%	50,10%
	Benchmark														
	Dif.														
2024	Fundo	1,06%	0,78%	0,86%	0,79%	0,82%	0,76%							5,18%	57,87%
	Benchmark														
	Dif.														

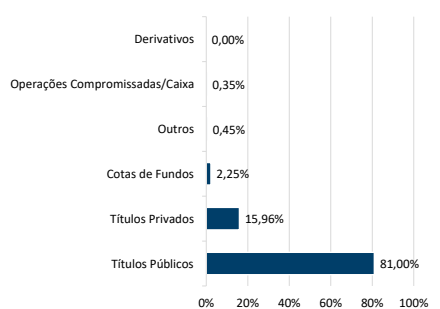
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	0	2
Nº Meses >0	12	78
Nº Meses <Benchmark	-	-
Nº Meses >Benchmark	-	-
Maior Rentabilidade Mensal	1,17%	1,17%
Menor Rentabilidade Mensal	0,76%	-1,35%
Maximum Drawdown	0,00%	1,87%
Volatilidade Anualizada	0,17%	0,43%
Índice de Sharpe	-1,06	-5,58

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	Dif.
Últimos 3 meses	2,39%		
Últimos 6 meses	5,18%		
Últimos 12 meses	11,51%		
Últimos 24 meses	25,30%		
Últimos 36 meses	36,16%		
Últimos 48 meses	39,74%		
Últimos 60 meses	43,14%		
Desde o início	57,87%		

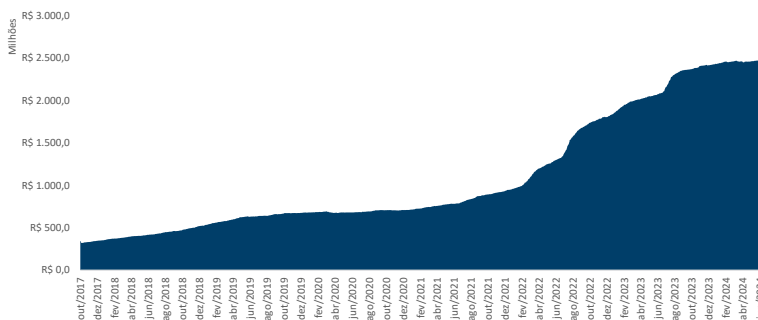
Composição da Carteira*



Data da carteira: jun/2024

*Número de aberturas consecutivas: 5

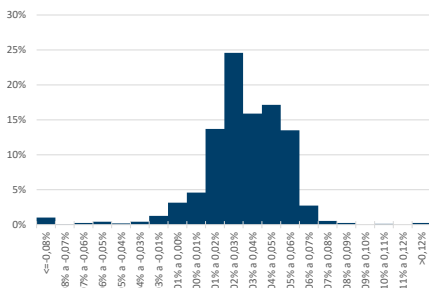
Evolução do Patrimônio Líquido



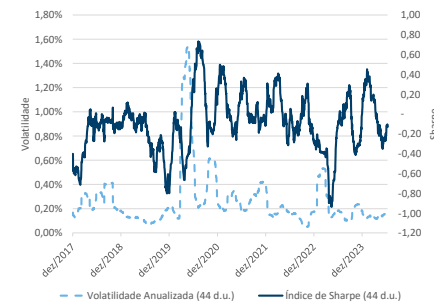
Patrimônio Líquido

Atual	R\$ 2.474.374.829,00
Médio nos últimos 12 meses	R\$ 2.393.608.330,91
Médio desde o início	R\$ 1.101.931.261,44

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 aprovados a partir de 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é de até 10 (dez) dias úteis 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 distanciamientos 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)

