RELATÓRIO DIÁRIO - FUNDOS ICATU VANGUARDA

16/04/2024

ICATU | VANGUARDA

	INFORMAÇÕES DIÁRIAS DOS FUNDOS					RENTABILIDADE						RENTABILIDADE ACUMULADA						INFORMAÇÕES ADICIONAIS					REGRAS DE RESGATE	
	CNPJ	Data Cota	Valor Cota	Benchmark	PL Diário	Diário	Comparativo Benchmark	No Mês	Comparativo Benchmark	No Ano	Comparativo Benchmark	Últimos 12 meses	Comparativo Benchmark	Últimos 24 meses	Comparativo Benchmark	Últimos 36 meses	Comparativo Benchmark	PL MÉDIO (12 meses)	TX ADM (% a.a)	TX MÁXIMA (% a.a)	PERFORMANCE	DATA DE INÍCIO	Prazo de Cotização	Prazo de Liquidação
FUNDOS ABERTOS																								
RENDA FIXA					**R$ 4.952.166.279**																			
ICATU VANGUARDA SIMPLES SOBERANO FIRF	14.843.784/0001-24	16/04/2024	1,9105064	CDI	R$ 99.802.209	0,041%	102,84%	0,47%	97,82%	3,11%	99,77%	12,26%	99,45%	27,05%	99,15%	36,26%	100,91%	R$ 178.220.242	0,15%	0,15%	-	01/03/2016	D+0	D+0
ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO FIRF LP	07.900.255/0001-50	15/04/2024	5,7415524	CDI	R$ 424.872.911	0,051%	126,62%	0,52%	117,68%	4,05%	131,47%	14,41%	117,29%	27,47%	100,87%	37,87%	105,53%	R$ 486.417.349	0,35%	0,35%	20% s/ 100% do CDI	17/05/2006	D+0	D+1 DU (da solicitação)
ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO LIQUIDEZ FIRF LP***	44.917.374/0001-41	15/04/2024	5,7094384	CDI	R$ 210.356.341	0,043%	106,49%	0,50%	112,71%	3,91%	127,14%	14,54%	118,33%	26,76%	98,25%	37,10%	103,38%	R$ 157.403.059	0,40%	0,40%	20% s/ 100% do CDI	17/05/2006	D+0	D+1 DU (da solicitação)
ICATU VANGUARDA FIRF PLUS LP	05.755.769/0001-33	15/04/2024	8,0629792	CDI	R$ 612.356.070	0,025%	61,82%	0,39%	88,41%	3,32%	107,99%	13,09%	106,50%	26,55%	97,50%	35,74%	99,59%	R$ 613.933.965	0,30%	0,30%	20% s/ 100% do CDI	03/11/2003	D+0	D+1 DU (da solicitação)
ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FIRF	36.521.750/0001-56	15/04/2024	1,4274162	CDI	R$ 464.068.474	0,048%	120,59%	0,57%	128,33%	4,49%	145,85%	15,68%	127,58%	27,34%	100,40%	38,62%	107,60%	R$ 423.050.934	0,40%	0,40%	20% s/ 100% do CDI	19/10/2020	D+30 DC	D+1 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA PG FIM CP	35.609.382/0001-30	15/04/2024	1,5842494	CDI	R$ 737.533.241	0,043%	106,68%	0,53%	120,36%	4,64%	150,75%	16,48%	134,07%	29,65%	108,87%	43,05%	119,95%	R$ 654.198.652	0,45%	0,55%	20% s/ 100% do CDI	08/01/2020	D+30 DC	D+1 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA CREDIT PLUS FIC FIRF CP	32.760.042/0001-17	15/04/2024	1,5998282	CDI	R$ 571.854.761	0,050%	124,26%	0,58%	130,32%	4,66%	151,43%	16,73%	136,14%	29,07%	106,76%	42,99%	119,78%	R$ 540.264.199	0,50%	0,50%	20% s/ 100% do CDI	17/06/2019	D+45 DC	D+1 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FIRF LP	10.922.432/0001-03	15/04/2024	4,6573772	IMA B5	R$ 215.108.626	-0,072%	0,00%	-0,11%	-	1,91%	-	8,58%	-	18,91%	-	29,82%	-	R$ 350.706.812	0,25%	0,25%	-	23/07/2009	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FIC FIRF LP	12.682.783/0001-10	15/04/2024	3,7539682	IMA B5	R$ 65.752.004	-0,074%	-	-0,14%	-	1,74%	-	8,00%	-	17,64%	-	27,71%	-	R$ 130.943.999	0,50%	0,76%	-	02/12/2010	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO FIRF LP	19.719.727/0001-51	15/04/2024	2,9696159	IMA B5	R$ 505.212.304	-0,156%	-	-0,34%	-	2,71%	0,76%	11,65%	2,88%	20,57%	0,95%	31,62%	0,60%	R$ 521.249.290	0,40%	0,40%	20% s/ 100% do IMA B-5	25/04/2014	D+5 DU	D+6 DU (da solicitação)
ICATU VANGUARDA TOTAL RETURN CP INSTITUCIONAL FIRF LP**	44.212.261/0001-40	15/04/2024	2,9775665	CDI	R$ 228.463.755	-0,153%	-	-0,30%	-	2,78%	90,23%	12,61%	102,65%	20,90%	76,73%	31,97%	89,08%	R$ 214.779.552	0,45%	0,45%	20% s/ 100% do CDI	25/04/2014	D+30 DC	D+1 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA INCENTIVADO EM INFRAESTRUTURA FIRF LP	34.793.170/0001-92	15/04/2024	1,5522944	-	R$ 148.738.293	-0,164%	-	-0,17%	-	4,57%	-	16,14%	-	22,70%	-	36,44%	-	R$ 122.839.029	0,50%	0,50%	20% s/ 100% do IPCA	27/12/2019	D+30 DC	D+1 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA PRÉ FIXADO FIRF LP	19.418.031/0001-95	15/04/2024	2,7384788	IRFM 1+	R$ 268.850.636	-0,684%	-	-1,88%	-	-1,33%	-	12,92%	-	26,23%	-	20,74%	-	R$ 224.205.350	0,30%	0,35%	20% s/ 100% do IRF-M 1+	11/04/2014	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FIRF LP	10.756.541/0001-06	15/04/2024	5,0908858	IMA B5+	R$ 313.594.063	-0,332%	0,00%	-1,42%	-	-3,00%	-	8,89%	-	16,32%	-	16,14%	-	R$ 233.617.425	0,25%	0,25%	-	26/06/2009	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FIC FIRF LP	07.400.556/0001-14	15/04/2024	8,0838052	IMA B5+	R$ 85.602.592	-0,332%	0,00%	-1,44%	-	-3,13%	-	8,33%	-	15,04%	-	14,25%	-	R$ 105.379.011	0,50%	0,76%	-	23/05/2007	D+0	D+1
MULTIMERCADO					**R$ 640.149.926**																			
ICATU VANGUARDA TOTAL RETURN CP PG FIM**	44.212.301/0001-54	15/04/2024	3,0827368	CDI	R$ 31.225.782	-0,174%	-	-0,34%	-	2,96%	96,05%	13,78%	112,17%	25,17%	92,41%	36,63%	102,07%	R$ 54.011.879	0,50%	0,50%	20% s/ 100% do CDI	25/04/2014	D+30 DC	D+1 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA HEDGE FIM	22.504.092/0001-80	15/04/2024	202,4377252	CDI	R$ 78.176.387	-0,239%	-	-0,77%	-	-0,61%	-	7,28%	59,24%	19,86%	72,91%	29,44%	82,02%	R$ 92.571.389	1,50%	2,00%	20% s/ 100% do CDI	21/08/2015	D+1	D+1 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA MULTIESTRATÉGIA FIC FIM CP	15.578.409/0001-67	15/04/2024	2,8219963	CDI	R$ 260.858.180	-0,010%	-	0,26%	57,91%	3,24%	105,26%	13,47%	109,63%	24,57%	90,21%	31,57%	87,95%	R$ 235.200.045	0,01%	1,00%	-	03/09/2012	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA MULTIESTRATÉGIA MODERADO FIC FIM	04.820.026/0001-37	15/04/2024	15,0893699	-	R$ 251.507.671	-0,220%	-	-0,73%	-	0,43%	-	12,79%	-	21,62%	-	24,03%	-	R$ 254.461.516	0,01%	1,00%	-	01/03/2002	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA MULTIESTRATÉGIA ARROJADO FIC FIM	10.841.477/0001-53	15/04/2024	3,5420554	-	R$ 18.381.906	-0,301%	-	-1,17%	-	-1,51%	-	12,99%	-	18,56%	-	17,17%	-	R$ 17.216.898	0,01%	1,00%	-	30/06/2009	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
INVESTIMENTO NO EXTERIOR					**R$ 51.418.054**																			
ICATU VANGUARDA DÓLAR FI CAMBIAL	32.745.560/0001-61	15/04/2024	1,4746791	-	R$ 1.048.553	0,939%	-	3,45%	-	7,93%	-	10,21%	-	21,03%	-	1,51%	-	R$ 1.407.619	0,22%	0,22%	-	30/04/2019	D+0	D+1
ICATU VANGUARD FOF FIM IE	39.997.963/0001-47	15/04/2024	0,9789534	-	R$ 30.667.190	0,554%	-	1,47%	-	6,02%	-	8,39%	-	11,29%	-	-10,30%	-	R$ 43.590.544	1,00%	1,00%	20% s/ 100% do Dólar Limpo+ FED Funds Over	22/12/2020	D+10 DC	D+3 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA FOF AÇÕES GLOBAL FI IE	44.212.682/0001-71	15/04/2024	1,3264589	-	R$ 19.702.311	-0,026%	-	-0,40%	-	11,47%	-	23,16%	-	-	-	-	-	R$ 25.954.796	1,00%	1,00%	20% s/ 100% do MSCI WORLD Total Return NET	25/05/2022	D+10	D+13
DATA - ALVO					**R$ 174.424.929**																			
ICATU VANGUARDA DATA ALVO 2030 FIC FIM CP	15.586.797/0001-28	15/04/2024	2,8188976	-	R$ 68.912.593	-0,105%	-	-0,29%	-	1,82%	-	13,00%	-	20,54%	-	22,66%	-	R$ 67.575.215	0,01%	1,50%	-	03/09/2012	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA DATA ALVO 2040 FIC FIM CP	15.586.796/0001-83	15/04/2024	2,7060241	-	R$ 58.230.198	-0,243%	-	-0,94%	-	0,14%	-	14,16%	-	18,06%	-	14,60%	-	R$ 53.976.497	0,01%	1,50%	-	03/09/2012	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA DATA ALVO 2050 FIC FIM CP	21.082.082/0001-30	15/04/2024	1,6259531	-	R$ 37.077.092	-0,330%	-	-1,38%	-	-1,26%	-	14,92%	-	14,46%	-	8,46%	-	R$ 34.669.017	0,01%	1,50%	-	23/03/2018	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA DATA ALVO 2060 FIC FIM CP	44.212.606/0001-66	15/04/2024	1,2489738	-	R$ 10.205.046	-0,362%	-	-1,54%	-	-1,87%	-	15,03%	-	13,90%	-	-	-	R$ 8.722.806	0,01%	2,00%	-	06/01/2022	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
AÇÕES					**R$ 1.121.454.860**																			
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FIF MULTIMERCADO - RL	35.637.151/0001-30	15/04/2024	1,3493369	IMA B5	R$ 399.733.156	-0,429%	-	-1,40%	-	-0,18%	-	14,61%	5,85%	29,21%	9,59%	30,08%	-	R$ 289.068.678	2,00%	2,00%	20% s/ 100% do IMA B-5	30/12/2019	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED 2 FIF MULTIMERCADO - RL****	54.198.519/0001-55	15/04/2024	1,3485842	IMA B5	R$ 16.714.652	-0,462%	-	-1,45%	-	-0,23%	-	14,55%	5,78%	29,14%	9,52%	30,00%	-	R$ 279.744.634	2,00%	2,00%	20% s/ 100% do IMA B-5	30/12/2019	D+30 DC	D+2 DU (da conversão)
ICATU VANGUARDA IBX FIA	06.224.719/0001-92	15/04/2024	8,5755514	IBX	R$ 81.178.634	-0,447%	0,00%	-2,11%	-	-6,33%	-	17,69%	-	6,71%	-	0,67%	-	R$ 70.112.544	0,55%	0,55%	20% s/ 100% do IBrX100	18/05/2004	D+1 DU	D+3 DU (da solicitação)
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	15/04/2024	5,0670348	IBX	R$ 623.828.418	-0,488%	-	-2,72%	-	-6,71%	-	14,06%	-	4,70%	-	-6,72%	-	R$ 673.132.547	2,00%	2,00%	-	24/10/2006	D+1	D+3
Indicadores Financeiros																								
CDI	-	-	-	-	-	0,040%	-	0,44%	-	3,08%	-	12,29%	-	27,23%	-	35,89%	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B (Ref.: IPCA)	-	-	-	-	-	-0,208%	-	-0,78%	-	-0,61%	-	9,22%	-	18,52%	-	24,29%	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5 (Ref.: IPCA)	-	-	-	-	-	-0,074%	-	-0,10%	-	1,95%	-	8,77%	-	19,62%	-	31,02%	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5 + (Ref.: IPCA)	-	-	-	-	-	-0,333%	-	-1,41%	-	-2,89%	-	9,19%	-	17,18%	-	17,51%	-	-	-	-	-	-	-	-
DÓLAR	-	-	-	-	-	0,984%	-	3,46%	-	6,77%	-	5,12%	-	11,33%	-	-7,19%	-	-	-	-	-	-	-	-
IBX	-	-	-	-	-	-0,451%	-	-2,04%	-	-6,24%	-	18,23%	-	6,80%	-	1,29%	-	-	-	-	-	-	-	-
IBOVESPA	-	-	-	-	-	-0,486%	-	-2,16%	-	-6,60%	-	18,22%	-	8,34%	-	3,49%	-	-	-	-	-	-	-	-

(* Responsabilidade LTDA.)

(** FUNDOS ORIUNDOS DA CISÃO DO FUNDO ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO, SENDO ASSIM, CONSIDERAMOS O HISTÓRIOCO DE COTAS DESDE 25/04/2014)

(*** FUNDO ORIUNDO DA CISÃO DO FUNDO ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO FIRF LP, SENDO ASSIM, CONSIDERAMOS O HISTÓRIOCO DE COTAS DESDE 17/05/2006)

(**** FUNDO ORIUNDO DA CISÃO DO FUNDO ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FIM, SENDO ASSIM, CONSIDERAMOS O HISTÓRIOCO DE COTAS DESDE 30/12/2019)

Autorregulação ANBIMA — Gestão de Recursos

Em atendimento à Instrução CVM nº 555, qualquer divulgação sobre os resultados do fundo só podem ser feita, por qualquer meio, após um período de carência de 6 (seis) meses, a partir da data da primeira emissão de cotas.

Este documento foi elaborado pela Icatu Vanguarda com fins meramente informativos. Apesar do cuidado utilizado tanto na obtenção quanto no manuseio das informações apresentadas, a Icatu Vanguarda não se responsabiliza pela publicação acidental de informações incorretas, nem tampouco por decisões de investimentos tomadas com base nas informações contidas neste documento, as quais podem inclusive ser modificadas sem comunicação. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do fundo garantidor de créditos - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Para avaliação da performance dos fundos é recomendável uma análise de período mínimo de 12 (doze) meses. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos.