

RELATÓRIO DIÁRIO - FUNDOS ICATU VANGUARDA

13/01/2022



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 Colocação	Prazo de Liquidação

FUNDOS ABERTOS

RENDA FIXA																								
R\$ 5.529.852.400																								
ICATU VANGUARDA SIMPLES SOBERANO FIRF	14.843.784/0001-24	13/01/2022	1,4633347	CDI	R\$ 124.886.291	0,039%	111,12%	0,31%	100,05%	0,31%	100,05%	4,67%	102,33%	6,94%	96,21%	12,62%	93,99%	R\$ 32.162.425	0,15%	0,15%	-	01/03/2016	D+0	D+0
ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO FIRF LP	07.900.255/0001-50	12/01/2022	4,3770155	CDI	R\$ 1.221.348.134	0,041%	116,62%	0,32%	114,93%	0,32%	114,93%	6,04%	133,25%	9,41%	131,02%	15,96%	119,20%	R\$ 1.216.392.759	0,35%	0,35%	20% s/ 100% do CDI	17/05/2006	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA FIRF PLUS LP	05.755.769/0001-33	12/01/2022	6,1899993	CDI	R\$ 461.686.723	0,070%	200,92%	0,26%	93,46%	0,26%	93,46%	4,92%	108,59%	7,89%	109,88%	14,46%	108,00%	R\$ 276.554.845	0,30%	0,30%	20% s/ 100% do CDI	03/11/2003	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FIRF	36.521.750/0001-56	12/01/2022	1,0888457	CDI	R\$ 235.929.447	0,059%	170,02%	0,41%	147,55%	0,41%	147,55%	6,93%	152,98%	-	-	-	-	R\$ 123.687.698	0,40%	0,40%	20% s/ 100% do CDI	19/10/2020	D+30	D+31
ICATU VANGUARDA PG FIM CP	35.609.382/0001-30	12/01/2022	1,1853846	CDI	R\$ 97.614.882	0,053%	152,44%	0,44%	157,57%	0,44%	157,57%	8,41%	185,67%	16,81%	234,11%	-	-	R\$ 36.223.514	0,45%	0,55%	20% s/ 100% do CDI	08/01/2020	D+30	D+31
ICATU VANGUARDA CREDIT PLUS FIC FIRF CP	32.760.042/0001-17	12/01/2022	1,2002504	CDI	R\$ 358.027.075	0,066%	190,16%	0,53%	189,21%	0,53%	189,21%	8,55%	188,81%	15,06%	209,78%	-	-	R\$ 317.899.496	0,50%	0,50%	20% s/ 100% do CDI	17/06/2019	D+45	D+46
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FIC FIRF LP	10.922.432/0001-03	12/01/2022	3,7342715	IMA B5	R\$ 723.476.155	0,211%	0,00%	-0,05%	-	-0,05%	-	4,02%	-0,38%	11,42%	-0,87%	24,62%	-1,21%	R\$ 995.325.368	0,25%	0,25%	-	23/07/2009	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FIC FIRF LP	12.682.783/0001-10	12/01/2022	3,0473648	IMA B5	R\$ 225.765.739	0,208%	0,00%	-0,07%	-	-0,07%	-	3,49%	-0,91%	10,19%	-2,10%	22,55%	-3,28%	R\$ 296.911.596	0,50%	0,76%	-	02/12/2010	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO FIRF LP	19.719.727/0001-51	12/01/2022	2,3441359	IMA B5	R\$ 1.121.123.643	0,330%	0,12%	-0,31%	-	-0,31%	-	4,17%	-0,23%	11,41%	-0,88%	24,17%	-1,66%	R\$ 993.747.872	0,40%	0,40%	20% s/ 100% do IMA B-5	25/04/2014	D+5	D+6
ICATU VANGUARDA PRÉ FIXADO FIRF LP	19.418.031/0001-95	12/01/2022	2,1609801	IFRM 1+	R\$ 158.932.322	0,952%	0,28%	-1,71%	-	-1,71%	-	-9,11%	-	-4,05%	-	11,18%	-3,61%	R\$ 315.658.044	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	12/01/2022	4,1787319	IMA B5+	R\$ 504.231.507	0,671%	0,00%	-2,62%	-	-2,62%	-	-7,81%	-	-4,80%	-	16,07%	-1,34%	R\$ 824.544.197	0,25%	0,25%	-	26/06/2009	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FIC FIRF LP	07.400.556/0001-14	12/01/2022	6,7193007	IMA B5+	R\$ 171.616.756	0,667%	-0,01%	-2,63%	-	-2,63%	-	-8,25%	-	-5,82%	-	14,23%	-3,17%	R\$ 258.725.743	0,50%	0,76%	-	23/05/2007	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA INCENTIVADO EM INFRAESTRUTURA FIRF	34.793.170/0001-92	12/01/2022	1,2087960	-	R\$ 125.213.727	0,199%	-	0,35%	-	0,35%	-	6,88%	-	19,07%	-	-	-	R\$ 106.046.941	0,50%	0,50%	20% s/ 100% do IPCA	27/12/2019	D+30	D+31

MULTIMERCADO																								
R\$ 609.066.940																								
ICATU VANGUARDA HEDGE FIM	22.504.092/0001-80	12/01/2022	163,1855498	CDI	R\$ 123.923.030	0,148%	425,61%	0,41%	148,12%	0,41%	148,12%	5,99%	132,20%	7,87%	109,57%	14,09%	105,28%	R\$ 119.486.389	1,50%	2,00%	20% s/ 100% do CDI	21/08/2015	D+1	D+2
ICATU VANGUARDA MULTISTRATÉGIA FIC FIM CP	15.876.409/0001-67	12/01/2022	2,2182785	CDI	R\$ 153.263.586	0,166%	477,36%	-0,19%	-	-0,19%	-	3,90%	86,01%	8,96%	124,82%	17,94%	134,01%	R\$ 61.893.116	0,01%	1,00%	-	03/09/2012	D+1	D+2
ICATU VANGUARDA MULTISTRATÉGIA MODERADO FIC FIM	04.820.026/0001-37	12/01/2022	11,9716506	-	R\$ 300.373.535	0,525%	-	-0,29%	-	-0,29%	-	-3,50%	-	0,53%	-	14,40%	-	R\$ 295.792.853	0,01%	1,00%	-	01/03/2002	D+1	D+2
ICATU VANGUARDA MULTISTRATÉGIA ARROJADO FIC FIM	10.841.477/0001-53	12/01/2022	2,8596910	-	R\$ 20.914.661	0,870%	-	-0,17%	-	-0,17%	-	-3,33%	-	-4,79%	-	11,30%	-	R\$ 21.354.238	0,01%	1,00%	-	30/06/2009	D+1	D+3

INVESTIMENTO NO EXTERIOR																								
R\$ 85.389.793																								
ICATU VANGUARDA DÓLAR FI CAMBIAL	32.745.560/0001-61	12/01/2022	1,4415717	-	R\$ 10.592.127	-0,914%	-	-0,77%	-	-0,77%	-	1,04%	-	29,99%	-	-	-	R\$ 8.893.915	0,22%	0,22%	-	30/04/2019	D+0	D+1
ICATU VANGUARDA FOF FIM IE	39.997.963/0001-47	12/01/2022	1,0899079	-	R\$ 74.797.666	-0,704%	-	-1,24%	-	-1,24%	-	3,84%	-	-	-	-	-	R\$ 29.183.973	1,00%	1,00%	00% do Dólar Limpo+ FED Fi	22/12/2020	D+10	D+13

DATA - ALVO																								
R\$ 151.870.064																								
ICATU VANGUARDA DATA ALVO 2030 FIC FIM	15.586.797/0001-28	12/01/2022	2,2561398	-	R\$ 80.445.564	0,457%	-	-0,60%	-	-0,60%	-	-1,10%	-	2,30%	-	18,56%	-	R\$ 35.753.749	0,01%	1,50%	-	03/09/2012	D+1	D+3
ICATU VANGUARDA DATA ALVO 2040 FIC FIM	15.586.796/0001-83	12/01/2022	2,1596416	-	R\$ 51.223.234	0,935%	-	-0,97%	-	-0,97%	-	-7,12%	-	-4,94%	-	14,56%	-	R\$ 41.781.403	0,01%	1,50%	-	03/09/2012	D+1	D+3
ICATU VANGUARDA DATA ALVO 2050 FIC FIM CP	21.082.082/0001-30	12/01/2022	1,3203113	-	R\$ 40.201.266	1,299%	-	-0,56%	-	-0,56%	-	-9,14%	-	-7,32%	-	12,43%	-	R\$ 32.086.095	0,01%	1,50%	-	23/03/2018	D+1	D+3

AÇÕES																								
R\$ 1.148.420.288																								
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FIM	36.637.151/0001-30	12/01/2022	0,9491986	IMA B5	R\$ 48.812.676	1,337%	1,13%	-0,35%	-	-0,35%	-	-5,81%	-	-5,45%	-	-	-	R\$ 61.029.917	2,00%	2,00%	20% s/ 100% do IMA B-5	30/12/2019	D+30	D+32
ICATU VANGUARDA IBX FIA	06.224.719/0001-92	12/01/2022	7,3543090	IBX	R\$ 108.360.381	1,858%	0,02%	1,30%	0,18%	1,30%	0,18%	-7,58%	-	-4,98%	-	13,79%	1,78%	R\$ 160.352.565	0,55%	0,55%	20% s/ 100% do IBX100	18/05/2004	D+1	D+3
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	12/01/2022	4,3829201	-	R\$ 991.247.031	2,273%	-	-0,90%	-	-0,90%	-	-15,69%	-	-27,10%	-	-6,86%	-	R\$ 1.321.122.277	2,00%	2,00%	-	24/10/2006	D+1	D+3

Indicadores Financeiros																								
CDI	-	-	-	-	-	0,039%	-	0,28%	-	0,28%	-	4,53%	-	7,18%	-	13,39%	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B (Ref.: IPCA)	-	-	-	-	-	0,437%	-	-1,32%	-	-1,32%	-	-1,726%	-	3,41%	-	22,14%	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5 (Ref.: IPCA)	-	-	-	-	-	0,211%	-	-0,05%	-	-0,05%	-	4,401%	-	12,29%	-	25,83%	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5 + (Ref.: IPCA)	-	-	-	-	-	0,676%	-	-2,61%	-	-2,61%	-	-7,428%	-	-4,02%	-	17,41%	-	-	-	-	-	-	-	-
DÓLAR	-	-	-	-	-	-0,959%	-	-0,77%	-	-0,77%	-	1,04%	-	29,24%	-	51,81%	-	-	-	-	-	-	-	-
IBX	-	-	-	-	-	1,834%	-	1,13%	-	1,13%	-	-7,371%	-	-5,85%	-	12,01%	-	-	-	-	-	-	-	-
IBOVESPA	-	-	-	-	-	1,837%	-	0,82%	-	0,82%	-	-8,153%	-	-7,10%	-	8,51%	-	-	-	-	-	-	-	-

* ESTE FUNDO TEM MENOS DE 12 (DOZE) MESES, PARA AVALIAÇÃO DA PERFORMANCE DE FUNDO DE INVESTIMENTO É RECOMENDÁVEL A ANÁLISE DE, NO MÍNIMO, 12 (DOZE) MESES.

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.

