



RELATÓRIO DE DILIGÊNCIA E ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS
SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA**

SUMÁRIO

INTRODUÇÃO	3
ANÁLISE DE CARTEIRA	4
Composição da Carteira de Investimentos	4
Casamento de Ativo e Passivo	7
Evolução Patrimonial.....	8
Rentabilidade	9
Controle de Risco	10
Históricos de Movimentações.....	13
Liquidez	15
ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS.....	16
Instituições Financeiras.....	16
Análise da Situação das Instituições Financeiras	16
ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS	17
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 25.078.994/0001-90)	17
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 13.322.205/0001-35)	22
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP (CNPJ: 03.543.447/0001-03).....	23
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 11.328.882/0001-35)	25
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 23.215.097/0001-55)	27
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 14.386.926/0001-71)	29
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 11.060.913/0001-10) ..	30
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 10.740.670/0001-06)	31
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.588/0001-89)	32
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.861.554/0001-22)	37
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP (CNPJ: 13.077.418/0001- 49)	38
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 28.515.874/0001-09)	40
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA (CNPJ: 08.702.798/0001-25)	49
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP (CNPJ: 35.536.532/0001-22).....	51
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP (CNPJ: 03.737.206/0001-97)	53

ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA (CNPJ: 05.073.656/0001-58)	54
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 21.838.150/0001-49) .	57
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES (CNPJ: 10.418.335/0001-88)	60
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 00.822.059/0001-65)	61
BRDESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES (CNPJ: 03.394.711/0001-86)	63
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES (CNPJ: 29.258.294/0001-38).....	65
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES (CNPJ: 14.213.331/0001-14).....	67
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 07.882.792/0001-14)	69
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES (CNPJ: 06.988.623/0001-09)	71
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES (CNPJ: 03.660.879/0001-96).....	73
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 30.068.169/0001-44)	76
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES (CNPJ: 16.718.302/0001-30).....	79
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES (CNPJ: 14.476.729/0001-43).....	83
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 41.196.740/0001-22).....	86
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 36.671.926/0001-56).....	89
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 08.070.841/0001-87)	93
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18).....	103
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP (CNPJ: 30.036.235/0001-02)....	106
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP (CNPJ: 03.737.188/0001-43)	107
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO (CNPJ: 21.595.829/0001-54).....	108
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES (CNPJ: 28.578.936/0001-13)	109
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO (CNPJ: 17.431.816/0001-72)	110
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I (CNPJ: 21.470.644/0001-13).....	111
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES (CNPJ: 17.502.937/0001-68)	114
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I (CNPJ: 19.436.818/0001-80)	116
CONCLUSÃO	118
DISCLAIMER	120

INTRODUÇÃO

Em consideração ao grande fluxo de ocorrências e a amplitude do mercado de produtos financeiros disponíveis aos Regimes Próprios de Previdência Social, se faz necessário um acompanhamento com maior diligência, principalmente aos produtos que compõe a carteira de investimentos do Regime.

Mesmo em atendimento as demandas de auditoria de órgãos fiscalizadores, ou até mesmo em atendimento a necessidade de certificação, estes requerem maior atenção quanto as possíveis medidas (contingências), podendo chegar a níveis judiciais, seus auditados procuram alcançar um nível de responsabilidade e segurança.

Para que se obtenha tamanho controle e conhecimento, se faz necessário um acompanhamento técnico e legal das principais mudanças e acontecimentos que transcorrem os produtos financeiros e se tais medidas são passíveis de denegrir o patrimônio líquido do Regime.

Buscando transmitir tais informações, a Crédito e Mercado passa ao interessado respectivo Relatório de Diligência.

Este documento atende ao item 3.2.6 – Política de Investimentos, Manual PRÓ-GESTÃO V.3.2.

ANÁLISE DE CARTEIRA

Composição da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos – dezembro/2021

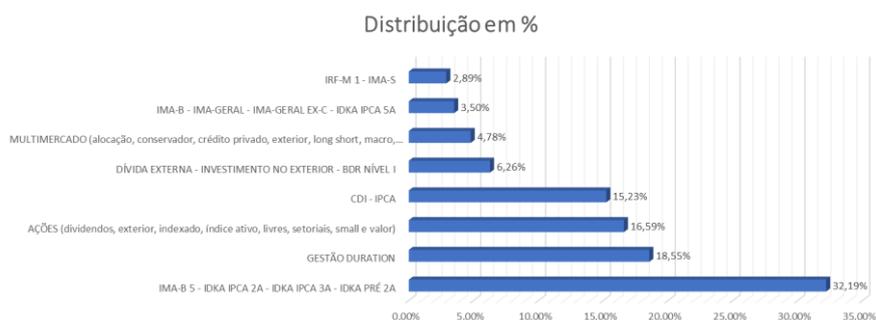
Produto / Fundo	Benchmark	Disponibilidade	Carência	Saldo	Carteira %
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-GERAL	D+3	Não há	1.506.084,86	1,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IDKA IPCA 2A	D+1	Não há	8.493.694,02	7,77%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	D+1	Não há	8.936.144,48	8,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IRF-M 1	D+0	Não há	1.154.227,08	1,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+0	Não há	4.904.334,93	4,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IDKA IPCA 2A	D+0	Não há	8.762.009,31	8,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B 5	D+0	Não há	9.007.879,77	8,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	D+0	Não há	2.009.503,74	1,84%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	GESTÃO DURATION	D+3	Não há	6.487.538,17	5,93%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	D+1	Não há	1.617.809,31	1,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	CDI	D+0	Não há	6.490.469,97	5,94%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+4	Não há	3.710.248,85	3,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	IMA-B	D+1	Não há	362.126,53	0,33%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	GESTÃO DURATION	D+1	Não há	2.983.360,98	2,73%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	D+0	Não há	10.167.374,94	9,30%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	IMA-B	D+1	Não há	342.501,34	0,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+1	Não há	2.196.762,51	2,01%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	AÇÕES - INDEXADO	D+4	Não há	1.032.705,83	0,94%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	D+4	Não há	1.825.409,34	1,67%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+33	Não há	2.404.568,36	2,20%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	AÇÕES - DIVIDENDOS	D+4	Não há	908.873,10	0,83%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+3	Não há	1.325.541,60	1,21%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	D+4	Não há	602.496,45	0,55%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	D+4	Não há	2.017.810,90	1,85%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+15	Não há	4.464.217,70	4,08%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+23 du	Não há	744.187,36	0,68%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+3	Não há	338.160,27	0,31%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+32	Não há	1.256.988,13	1,15%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+32	Não há	1.223.552,19	1,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - MACRO	D+4	Não há	2.544.736,47	2,33%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - MODERADO	D+15	Não há	1.550.011,48	1,42%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - EXTERIOR "d"	D+1	Não há	478.486,46	0,44%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	D+4	Não há	203.191,07	0,19%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERCADO - EXTERIOR "d"	D+2	Não há	445.422,38	0,41%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	AÇÕES - EXTERIOR	D+5 du	Não há	785.931,33	0,72%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	MULTIMERCADO - EXTERIOR	D+5 du	Não há	2.585.489,75	2,36%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	AÇÕES - EXTERIOR	D+4 du	Não há	1.246.411,53	1,14%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	AÇÕES - EXTERIOR	D+4	Não há	1.368.673,65	1,25%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	AÇÕES - EXTERIOR	D+5	Não há	862.169,36	0,79%

109.347.105,50

Fonte: Sistema Crédito e Mercado posição de dezembro de 2021

Distribuição Estratégica – novembro/2021

Sub-Segmento	Posição R\$	%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	0,00%
GESTÃO DURATION	20.282.245,44	18,55%
IDKA IPCA 20A - IMA-B 5+	0,00	0,00%
IMA-B - IMA-GERAL - IMA-GERAL EX-C - IDKA IPCA 5A	3.828.522,04	3,50%
IRF-M - IRF-M 1+	0,00	0,00%
IMA-B 5 - IDKA IPCA 2A - IDKA IPCA 3A - IDKA PRÉ 2A	35.199.727,58	32,19%
IRF-M 1 - IMA-S	3.163.730,82	2,89%
CDI - IPCA	16.657.844,91	15,23%
POUPANÇA - OP COMPROMISSADAS - CDB - CVS - DISPONIBILIDADE	0,00	0,00%
FIDC - ABERTO - FIDC - FECHADO - CRÉDITO PRIVADO	0,00	0,00%
AÇÕES (dividendos, exterior, indexado, índice ativo, livres, setoriais, small e valor)	18.144.511,23	16,59%
MULTIMERCADO (alocação, conservador, crédito privado, exterior, long short, macro, moderado e i	5.221.847,86	4,78%
FUNDO IMOBILIÁRIO	0,00	0,00%
FIP	0,00	0,00%
DÍVIDA EXTERNA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR - BDR NÍVEL I	6.848.675,62	6,26%
Total	109.347.105,50	100,00%



A carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA está segregada entre os segmentos de renda fixa, renda variável e investimentos no exterior, sendo 72,37%, 21,37% e 6,26% respectivamente, não ultrapassando o limite de 35% permitido pela Resolução CMN nº3.922/2010 em seu Art. 8º, § 9º, para o segmento de renda variável aos RPPS que já obtiveram a Certificação Institucional Pró-Gestão Nível I.

O INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA obteve a Certificação Institucional Pró-Gestão Nível I em 18 de setembro de 2020.

Retratando uma gestão moderada, a carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA apresenta uma considerável exposição em fundos de investimentos composto por 100% títulos públicos, atrelados a vértices de curto, médio e longo prazo.

Ainda em renda fixa, a maior exposição individual está em fundos de investimentos composto por 100% títulos públicos, atrelados a vértices de médio prazo, seguidos dos fundos de investimentos classificados como de gestão *duration*, que apresentam uma característica de gestão ativa por parte de seus gestores.

Não há participação em fundos de investimentos classificados como crédito privado ou fundos de investimentos em direitos creditórios.

No âmbito da renda variável, a carteira de investimentos apresenta participação em fundos de investimentos em ações, multimercado e fundos de investimentos classificados como investimentos no exterior.

Entre os fundos de investimentos em ações, suas classificações estão segregadas entre as estratégias:

- **INDEXADOS:** Fundos que têm como objetivo replicar as variações de indicadores de referência do mercado de renda variável;
- **ÍNDICE ATIVO:** têm como objetivo superar o índice de referência do mercado acionário se utilizando de deslocamentos táticos em relação à carteira de referência para atingir seu objetivo;
- **VALOR:** que buscam retorno por meio da seleção de empresas cujo valor das ações negociadas esteja abaixo do “preço justo” estimado (estratégia valor) e/ou aquelas com

histórico e/ou perspectiva de continuar com forte crescimento de lucros, receitas e fluxos de caixa em relação ao mercado (estratégia de crescimento);

- **DIVIDENDOS:** Fundos que investem em ações de empresas com histórico de *dividend yield* (renda gerada por dividendos) consistente ou que, na visão do gestor, apresentem essas perspectivas;
- **LIVRE:** não tem o compromisso de concentração em uma estratégia específica, onde a parcela em caixa pode ser investida em quaisquer ativos, desde que especificados em regulamento;
- **SMALL CAPS:** Fundos cuja carteira é composta por, no mínimo, 85% em ações de empresas que não estejam incluídas entre as 25 maiores participações do IBrX - Índice Brasil, ou seja, ações de empresas com relativamente baixa capitalização de mercado. Os 15% remanescentes podem ser investidos em ações de maior liquidez ou capitalização de mercado, desde que não estejam incluídas entre as dez maiores participações do IBrX – Índice Brasil e
- **EXTERIOR:** fundos de investimentos que investem em ativos financeiros no exterior em parcela superior a 40% do patrimônio líquido. Estes fundos seguem o disposto no art. 101 da Instrução nº 555 da CVM. No âmbito dos fundos de investimentos classificados como Multimercado, o hedge cambial da parcela de ativos no exterior é facultativo ao gestor.

Entre os fundos de investimentos multimercado, com exceção dos classificados como Investimentos no Exterior, já mencionados; estão segregados entre as estratégias:

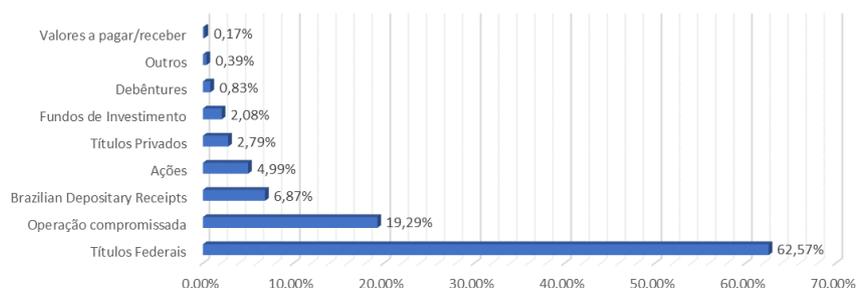
- **MACRO:** que realizam operações em diversas classes de ativos (renda fixa, renda variável, câmbio etc.), com estratégias de investimento baseadas em cenários macroeconômicos de médio e longo prazos;
- **ALOCAÇÃO:** que buscam retorno no longo prazo por meio de investimento em diversas classes de ativos (renda fixa, ações, câmbio etc.), incluindo cotas de fundos de investimento e
- **LIVRE OU MODERADO:** não tem o compromisso de concentração em alguma estratégia específica.

Distribuição Consolidada – dezembro/2021



Na demonstração da distribuição consolidada da carteira de investimento do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA, identifica-se que as 10 (dez) maiores participações dos investimentos realizados estão focadas em títulos públicos e operações compromissadas em títulos públicos federais.

Tipo de Aplicação



A distribuição consolidada da carteira de investimento do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA com posição atrelada ao mês de referência, está caracterizada por uma alta exposição em títulos públicos que somados as operações compromissadas em títulos públicos, representam juntos 88,73% do total do patrimônio. Há também participação em fundos de investimentos, ações, *Brazilian Depositary Receipts* – BDR, títulos privados e debêntures, que representam o somatório de 10,69% do total do patrimônio, além de outros demais ativos com baixa representatividade, que representam 0,56%.

Casamento de Ativo e Passivo

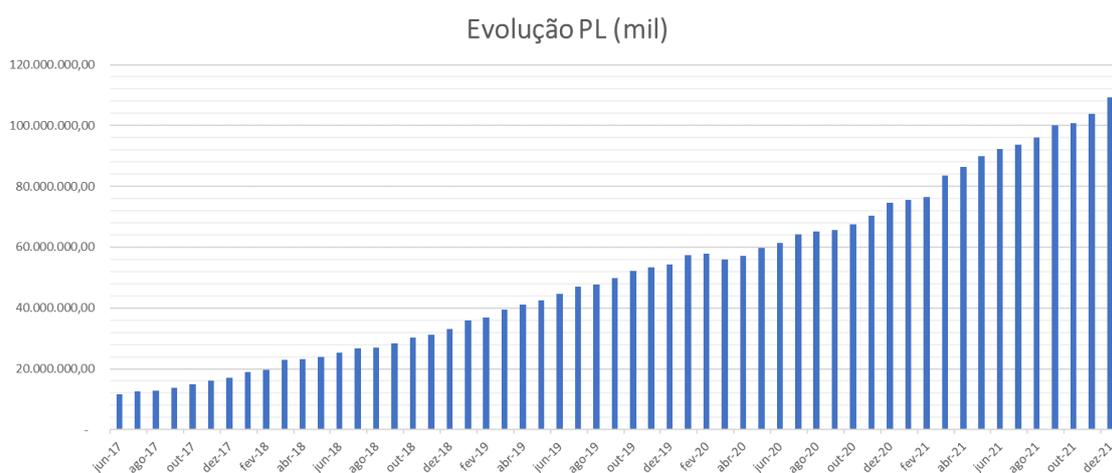
O estudo de casamento de ativo e passivo tem por objetivo identificar a razão de solvabilidade do plano de benefícios do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA, considerando premissas e hipóteses de simulação com base em fluxos de caixa atuarial e cenários macroeconômicos, e proporá composições de carteiras de investimentos que possam suportar e alongar a sobrevida do plano de benefícios, e que apresentem melhor relação entre resultado esperado (superávit projetado) e risco de déficit (medido como “downside risk”) no conjunto das combinações entre os cenários adotados para as variáveis de mercado (CDI, INPC, IPCA, IGP-M, Bolsa de Valores, etc.) e os cenários simulados para o fluxo de caixa líquido de benefícios.

Ao analisarmos o relatório apresentado referente ao fechamento de 2020, podemos considerar que o fluxo de caixa previdenciário para os próximos 12 (doze) anos é positivo, ou seja, o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA receberá valores provenientes de contribuições previdenciárias em volume superior aos compromissos previdenciários, havendo espaço para alongamento de parte dos investimentos da carteira, sem que comprometa o fluxo de pagamento dos benefícios futuros.

Entendemos que a otimização da carteira de investimentos considerando o cenário base, proporcionará a melhor relação risco x retorno no longo prazo. Permite ainda otimizar o resultado considerando intervenções na composição da carteira de investimento de forma a otimizar ganhos, respeitando sempre os limites máximos estabelecidos pela Resolução CMN nº 3.922/2010 e alterações.

O compromisso de conseguir honrar os pagamentos aos beneficiários futuramente deve ser a principal visão do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA.

Evolução Patrimonial



Destaca-se um crescimento contínuo e de boa curvatura evolutiva, não havendo períodos de retração ou declínio contínuo, havendo uma leve diminuição no patrimônio líquido ainda no primeiro trimestre de 2020, resultado esse devido ao péssimo desempenho do mercado financeiro.

Apesar dos acontecimentos mercadológicos e do impacto financeiro havido no mercado global, o patrimônio líquido do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA se manteve em crescimento tangente.

Em valores absolutos, podemos considerar que o patrimônio líquido do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA teve um crescimento de aproximadamente 201,49% nos últimos dois anos, uma variação de patrimônio equivalente a R\$55.077.962,18.

Chamamos a atenção quanto a possibilidade de haver novos períodos de retração ou declínio, que tentem a reproduzir a volatilidade do mercado, uma vez que a carteira de investimentos apresenta exposição em ativos de alta volatilidade, porém, com a diversificação equilibrada, as retrações poderão ser discretas ou quase imperceptíveis, apresentando posteriormente uma recuperação gradativa.

Rentabilidade



O retorno acumulado no período não supera sua meta de rentabilidade no longo prazo, contudo, há grande possibilidade de retomada e, conseqüentemente, superar a meta no longo prazo.

O resultado obtido pelo INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA representa 34,02% de rentabilidade acumulada, contra 62,83% de meta estabelecida.

Rentabilidade da Carteira de Investimentos

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO	ACUM
2018	Carteira	0,59%	0,59%	0,82%	0,35%	-1,09%	0,23%	1,14%	-0,14%	0,70%	2,12%	0,56%	1,07%	7,13%	7,13%
	Meta	0,80%	0,74%	0,58%	0,71%	0,89%	1,75%	0,84%	0,44%	0,92%	0,96%	0,25%	0,61%	9,91%	9,91%
2019	Carteira	1,74%	0,37%	0,47%	0,87%	1,45%	1,81%	1,04%	0,33%	1,29%	1,46%	-0,05%	1,49%	12,96%	21,02%
	Meta	0,83%	0,90%	1,19%	1,06%	0,64%	0,45%	0,72%	0,62%	0,45%	0,63%	0,98%	1,64%	10,58%	21,54%
2020	Carteira	0,44%	-0,84%	-5,36%	1,61%	2,11%	1,98%	2,17%	-0,64%	-1,09%	-0,02%	2,64%	2,73%	5,57%	27,76%
	Meta	0,71%	0,66%	0,57%	0,14%	0,07%	0,74%	0,88%	0,72%	1,12%	1,34%	1,35%	1,16%	9,87%	33,54%
2021	Carteira	-0,60%	-0,99%	0,61%	1,10%	1,41%	0,08%	-0,72%	-0,57%	-0,51%	-1,45%	0,78%	1,48%	0,57%	28,48%
	Meta	0,68%	1,25%	1,43%	0,74%	1,28%	0,98%	1,44%	1,35%	1,62%	1,68%	1,38%	1,23%	16,14%	55,09%

*Qualquer variação para mais ou a menos nos percentuais apresentados, representam fatores de arredondamento.

Em se tratando da rentabilidade para o exercício de 2021, o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA obteve no mês de referência o resultado de 1,48%, permitindo que seu resultado acumulado para o mesmo exercício aumentasse, ou seja, equivalente a 0,57%. A meta de rentabilidade, por sua vez, fechou o mês de referência com o resultado de 1,23%, acumulando para o mesmo exercício o montante de 16,14%.

Recomendamos que o cenário econômico seja melhor observado, considerando as possibilidades disponíveis dentro do quadro de diversificação voltados aos RPPS, principalmente na busca por fundos de investimentos específicos para Investidores Qualificados.

Controle de Risco

É relevante mencionar que qualquer aplicação financeira está sujeita à incidência de fatores de risco que podem afetar adversamente o seu retorno, e conseqüentemente, fica o RPPS obrigada a exercer o acompanhamento e o controle sobre esses riscos.

Quando se trata de risco de mercado, que é o risco inerente a todas as modalidades de aplicações financeiras disponíveis no mercado financeiro; corresponde à incerteza em relação ao resultado de um investimento financeiro ou de uma carteira de investimento, em decorrência de mudanças futuras nas condições de mercado. É o risco de variações, oscilações nas taxas e preços de mercado, tais como taxa de juros, preços de ações e outros índices. É ligado às oscilações do mercado financeiro.

Para considerarmos a relação Risco x Retorno observando também critérios como Volatilidade e VaR – *Value at Risk*, sendo o segundo, adotado pelo INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA para controle do risco de mercado.

Análise de Risco – carteira de dezembro/2021

	Dezembro de 2021				
	Retorno	VaR (95% MV 21 du)	Renda Fixa	Renda Variável	Invst. Exterior
Carteira de Investimentos	1,48%	2,69%	0,69%	7,95%	7,90%

Produto / Fundo	Dezembro de 2021		
	Retorno	Volatilidade	VaR (95% MV 21 du)
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,61%	23,78%	11,29%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,90%	21,41%	10,17%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	16,93%	8,04%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56%	16,80%	7,98%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5,42%	16,45%	7,81%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,08%	19,67%	9,34%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	3,89%	22,61%	10,74%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,56%	19,40%	9,21%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,45%	18,06%	8,58%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3,44%	19,45%	9,23%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3,41%	18,72%	8,89%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,99%	17,63%	8,37%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	2,47%	26,06%	12,37%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2,39%	19,76%	9,38%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,39%	15,07%	7,15%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2,00%	21,56%	10,24%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	18,86%	8,95%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	3,56%	1,69%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	4,65%	2,21%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,27%	5,59%	2,65%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1,25%	14,80%	7,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	2,11%	1,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,86%	0,49%	0,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	0,42%	0,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	0,42%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	0,48%	0,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	0,06%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	1,47%	0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	2,15%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	2,19%	1,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	1,66%	0,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,75%	0,09%	0,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,74%	0,13%	0,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,72%	2,31%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	2,22%	1,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	4,55%	2,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,16%	4,40%	2,09%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,08%	4,79%	2,27%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-1,60%	19,99%	9,49%

*Neste relatório não foram considerados as análises de fundos de investimentos considerados como "Estruturados", devido aos indicadores de desempenho e de análise de risco serem funcionais para fundos de investimentos que possuem risco de mercado como seu risco majoritário.

Os resultados apresentados pela carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA são reflexo das oscilações do mercado, mantendo-se a volatilidade e as incertezas.

O VaR da carteira de investimentos nos segmentos de renda fixa e renda variável estão em conformidade com a estratégia de risco traçada na Política Anual de Investimentos – PAI de 2021 e, caso haja o descasamento, para a regularização, sugerimos ater para as Políticas de Contingências.

O otimismo para os retornos positivos advindos dos fundos de investimentos de ações se mantém, com novas perspectivas e novas altas, principalmente para o exercício de 2021, proporcionado maior rentabilidade para a carteira de investimentos, contudo, deve-se analisar

o cenário econômico uma vez que os mercados, nacional e internacional, ainda estão sofrendo com o impacto do vírus COVID-19.

Históricos de Movimentações

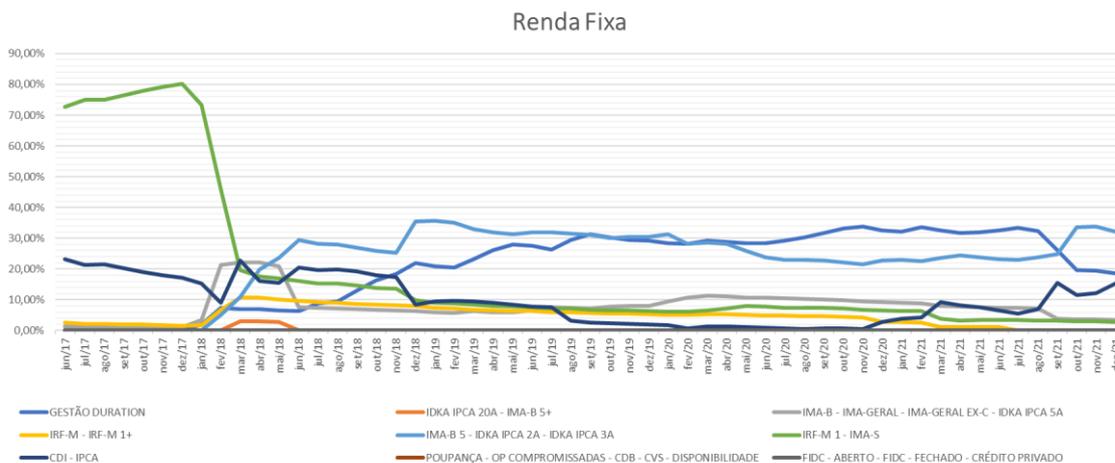
Histórico de Movimentações para o Exercício de 2021

Fundos de Investimentos	dez-20	jan-21	fev-21	mar-21	abr-21	mai-21	jun-21	jul-21	ago-21	set-21	out-21	nov-21	dez-21
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.287.526,27	1.288.205,41	1.288.948,23	1.298.533,78	1.492.630,30	1.566.556,36	1.570.265,96	1.573.545,79	1.580.330,76	1.587.820,36	1.577.171,26	1.592.595,58	1.605.503,74
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.257.518,27	1.247.473,62	1.232.621,43	611.808,27	616.788,14	617.768,36	618.836,21	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.543.822,62	1.544.307,51	1.544.372,70	1.544.538,68	1.513.833,01	1.529.853,85	1.511.888,13	1.513.768,30	1.517.540,24	1.541.707,23	1.535.798,71	1.544.562,44	1.554.227,08
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.073.529,66	2.055.978,26	2.079.707,93	6.519.441,46	6.063.385,56	5.707.402,49	5.203.323,98	4.261.120,68	4.865.798,62	6.969.112,89	5.403.338,24	4.742.953,87	6.490.462,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.657,54	2.959,45	127.628,46	1.156.992,24	1.105.628,35	1.142.229,81	883.078,88	925.998,79	1.848.115,24	8.648.762,30	6.235.037,04	7.804.476,03	10.167.374,94
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.343.458,47	5.496.262,86	5.462.200,38	7.099.396,94	7.330.089,91	7.379.760,49	7.368.712,20	7.368.798,48	7.379.600,21	7.838.910,01	8.239.998,08	8.939.276,58	9.007.879,77
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.553.263,96	4.526.113,77	4.486.729,70	4.487.824,07	4.485.600,01	4.517.215,47	4.522.220,00	4.530.961,97	4.480.713,25	4.491.257,77	4.657.094,96	4.492.442,44	4.506.084,86
BB IDUA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.212.575,12	4.220.031,00	4.196.895,15	4.212.424,71	4.247.804,04	4.276.303,31	4.272.304,60	4.275.870,25	4.283.501,30	5.328.008,81	8.234.113,55	8.434.132,01	8.493.694,02
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	844.676,91	838.163,47	828.498,57	409.718,75	412.903,31	413.600,38	414.354,30	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL IDUA IPCA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.156.916,30	3.161.134,44	3.144.512,07	3.156.331,40	3.852.138,40	4.120.293,04	4.121.111,40	4.118.457,24	5.411.179,24	5.848.098,78	8.318.624,82	8.699.398,78	8.702.029,11
BB IMA-B FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.285.513,85	4.523.091,15	4.495.702,03	5.172.932,88	5.662.051,01	5.700.913,19	5.609.215,75	5.691.500,78	5.697.996,89	5.753.029,80	8.624.502,89	8.868.546,91	8.736.144,48
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.379.226,66	1.377.650,91	1.373.785,77	1.379.951,80	1.387.843,80	1.393.816,90	1.396.606,90	1.397.622,51	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.449.078,73	2.388.138,16	2.310.869,57	2.314.462,90	2.393.038,25	2.536.412,62	2.580.481,00	2.463.313,92	2.407.460,57	2.208.700,00	2.017.743,44	1.978.162,64	2.017.810,90
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.290.819,99	5.262.171,63	5.209.794,58	5.315.447,71	5.209.681,04	5.014.810,64	5.066.360,03	5.039.960,77	5.660.429,37	5.654.792,45	5.626.640,64	5.601.430,17	5.710.248,85
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.092.093,53	4.097.574,21	4.100.024,79	4.105.951,10	4.110.362,33	2.116.617,46	2.122.733,28	2.126.042,19	2.132.558,95	2.122.406,82	2.127.746,43	2.128.014,60	2.196.762,51
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.508.546,47	2.506.130,90	2.491.997,73	2.526.244,23	2.554.464,84	2.591.156,98	2.586.785,19	2.577.397,10	2.542.198,92	2.524.391,91	2.500.953,34	2.544.736,47	2.544.736,47
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.798.849,52	1.698.593,10	1.612.866,68	1.752.174,56	2.094.401,38	2.213.921,03	2.395.307,41	2.577.820,96	2.531.147,21	2.467.221,18	2.330.956,19	2.310.379,97	2.404.568,36
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.350.573,49	1.302.451,36	1.302.309,28	1.988.825,29	1.854.849,67	1.973.168,69	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.642.044,84	1.627.941,91	1.602.615,33	1.594.591,05	1.605.015,76	1.621.944,78	1.628.408,16	1.622.125,59	1.604.051,86	1.601.965,83	1.560.470,60	1.614.488,60	1.617.809,11
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.514.327,29	1.517.970,58	1.511.616,61	1.535.521,10	1.544.025,65	1.565.295,95	1.565.273,03	1.568.002,14	1.548.249,44	1.536.067,31	1.518.525,23	1.528.177,82	1.550.011,48
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	370.792,40	367.006,41	360.478,60	358.095,52	360.945,18	364.118,95	365.737,07	364.120,35	359.885,24	359.154,63	349.617,60	361.512,30	362.126,13
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	347.609,92	343.945,47	338.343,65	335.827,78	338.559,21	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB INVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.564.521,85	1.517.089,57	1.462.247,71	1.638.433,21	1.672.201,64	1.768.573,64	1.975.324,41	2.131.582,94	2.077.061,16	1.938.129,30	1.803.950,01	1.782.748,34	1.825.409,34
BRADESCO FLUXO INVESPA FIC AÇÕES	897.905,67	864.529,44	832.164,51	877.281,33	1.095.989,68	1.163.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	668.239,49	650.379,85	645.344,63	665.469,76	694.356,90	752.029,28	758.715,31	732.761,19	712.564,64	684.728,16	598.888,51	579.921,98	602.496,45
ITAÚ MOMENTO 30FIC AÇÕES	2.975.554,12	2.914.875,40	2.807.528,05	2.774.390,38	2.873.587,98	3.002.728,55	3.056.731,45	2.989.592,74	963.063,34	887.416,29	890.000,00	0,00	0,00
CAIXA BV 30FI MULTIMERCADO LP	204.882,10	203.694,11	201.382,88	204.654,82	204.828,17	205.525,29	207.813,01	206.653,92	203.395,53	203.400,06	200.637,06	203.197,07	203.197,07
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	936.832,23	1.025.848,13	1.116.594,76	1.120.248,33	1.131.277,11	2.230.053,68	2.600.827,32	2.962.976,50	2.924.207,18	2.938.620,28	2.961.333,57	2.983.360,98	2.983.360,98
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.120.073,43	6.091.543,85	7.505.809,74	7.479.927,64	7.532.850,46	10.583.764,70	11.496.721,91	12.472.945,58	12.416.209,30	12.425.521,28	6.340.802,98	6.438.532,34	6.487.538,17
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIC AÇÕES	58.472,20	62.813,89	65.145,20	67.678,23	67.790,81	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.766.146,27	7.768.130,36	7.728.683,93	9.317.551,49	10.043.697,17	10.043.394,95	9.965.498,68	9.821.037,49	4.852.598,25	4.820.501,47	4.864.171,17	4.904.334,93	4.904.334,93
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	890.325,14	1.118.862,41	1.178.674,92	1.169.267,64	1.136.743,13	1.113.337,61	1.069.004,31	1.299.301,33	1.279.934,97	1.325.541,60
BB GOVERNANÇA FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	298.069,85	314.504,96	517.940,15	748.089,80	724.509,97	676.595,01	900.867,34	998.373,10	1.032.705,83
BB DIVIDENDOS INDICAP FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	399.261,61	420.079,58	618.640,64	599.461,64	589.899,15	565.549,59	899.024,91	878.823,94	908.873,10
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	343.033,64	344.611,71	343.778,02	340.333,61	341.223,37	343.402,02	342.210,97	342.501,34
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	451.933,45	635.843,74	665.907,49	705.509,94	707.618,38	762.242,68	776.262,99	785.931,33
BB AÇÕES ESG FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	200.862,50	496.066,56	522.550,00	538.703,99	542.526,86	926.262,18	1.120.397,80	1.146.411,53
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	268.586,03	618.128,33	651.633,20	667.500,07	663.816,62	957.763,22	1.345.759,55	1.368.673,65
BRADESCO INOVESPA PLUS FI AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.167.988,47	1.121.674,89	1.093.566,99	1.021.208,14	971.001,25	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.056.079,80	2.815.788,06	4.081.113,36	4.514.448,82	4.242.448,27	4.220.344,62	4.464.217,70	4.464.217,70
CAIXA INDOIA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	429.413,83	443.752,22	423.168,68	455.509,27	457.377,39
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	635.543,02	2.050.180,43	2.110.548,88	2.562.717,74	2.525.097,19
SARFA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	299.849,40	258.052,92	180.014,49	138.160,27
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	500.786,13	777.895,22	1.154.215,52	1.256.988,13
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	489.161,75	759.889,18	1.116.288,58	1.223.552,19
SARFA S&P REAR PB FI MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	394.872,57	424.669,33	422.504,53	445.422,38
SARFA CONSÓLIO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	297.622,58	516.123,44	833.432,86	862.169,36
ITAÚ MOMENTO 30 FI AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	786.454,76	756.263,39	744.187,36
74.602.048,07	75.492.986,48	76.557.360,53	83.489.966,39	86.350.207,28	89.972.365,32	92.192.899,76	93.643.066,55	95.598.370,49	99.969.864,64	100.727.044,25	103.748.631,90	109.347.105,50	

Movimentações de dezembro/2021

Produto / Fundo	Benchmark	Data de Movimentação	Movimento R\$	Benchmark	Movimento R\$ Final
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	01/12/2021	-22.810,03	CDI	4.001.259,77
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	03/12/2021	5.880,78		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	03/12/2021	2.434,32		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	10/12/2021	-5.000,00		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	14/12/2021	-980,55		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	15/12/2021	-50.517,70		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	15/12/2021	173.452,22		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	15/12/2021			

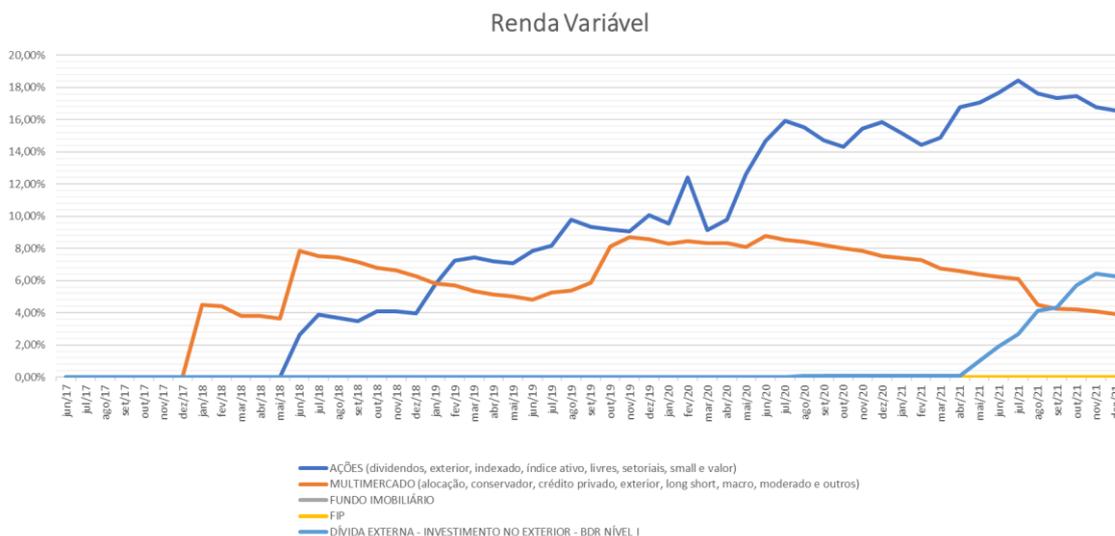
Histórico de Movimentações Acumulado



A exposição em renda fixa sai da grande concentração em curto prazo, trazendo essa posição para uma diversificação em vértices de médio e longo prazo, sendo o primeiro maior. A busca por fundos de investimentos classificados como gestão *duration* traz maior exposição em fundos de investimentos de gestão ativa, proporcionando retornos frente a seu benchmark. Não podemos deixar de destacar a discreta troca de posição entre CDI e fundos de investimentos compostos de títulos públicos, atrelados a vértices de longo prazo.

A exposição da carteira em renda fixa não acompanha fortes oscilações, mantendo-se praticamente inerte em 2020, com exceção das singelas oscilações em gestão *duration*, CDI e IMA-B 5, que ainda assim não apresentaram grandes mudanças quanto ao volume de exposição, mantendo-se dessa forma até o presente momento.

No primeiro semestre do exercício de 2021, a carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA manteve sua posição inicial, não promovendo grandes movimentações de realocação.



A introdução de renda variável na carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA iniciou contemplando fundos de investimentos classificado como multimercado e posteriormente fundos de investimentos em ações. A busca pela diversificação considerando as classes proporcionam um equilíbrio a carteira de investimentos, demonstrando a busca pela mitigação dos riscos e obtenção de melhores retornos.

Podemos observar a acentuada curvatura na exposição em fundos de investimentos em ações, onde demonstra claramente a oscilações ocorridas no mercado frente aos principais acontecimentos.

Observa-se que no início do primeiro trimestre de 2020, o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA buscou aumentar sua exposição em renda variável, principalmente em fundos de investimentos classificados como ações.

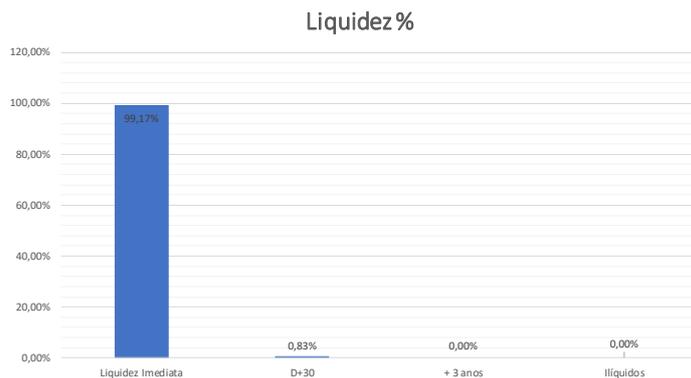
A diminuição de exposição em fundos de investimentos em ações demonstrado no gráfico, não foi promovido pelas movimentações e sim pelos principais acontecimentos mercadológicos. Em maio e julho do mesmo exercício, vemos a retomada de exposição devido à volatilidade e perspectiva de retorno do mercado e pela promoção de novos aportes.

No exercício de 2021, ainda no primeiro semestre, o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA de forma arrojada, buscou oportunidades em fundos de investimentos no exterior. Sua evolução manteve-se constante até o mês de análise.

Liquidez

A carteira de investimentos possui liquidez imediata de 100,00% para auxílio no cumprimento das obrigações do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA.

Disponibilidade	Saldo	%
Liquidez Imediata	108.438.232,40	99,17%
D+30	908.873,10	0,83%
+ 3 anos	-	0,00%
Ilíquidos	-	0,00%
	109.347.105,50	



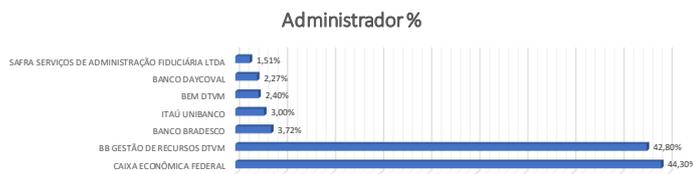
Recomendamos aos gestores que a importância de compreender a necessidade da exposição da carteira de investimentos em ativos de menor liquidez, demonstra que os membros dirigentes objetivam retornos no longo prazo, possibilitam ao regime próprio arcar com seus compromissos futuros frente aos novos beneficiários.

ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

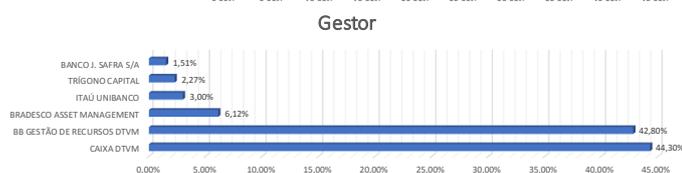
Instituições Financeiras

Os fundos de investimentos que compõe a carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA, tem como prestadores de serviços de Administração e Gestão os:

Administrador	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.443.780,50	44,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	46.800.898,73	42,80%
BANCO BRADESCO	4.072.375,38	3,72%
ITAÚ UNIBANCO	3.283.451,21	3,00%
BEM DTVM	2.620.307,35	2,40%
BANCO DAYCOVAL	2.480.540,32	2,27%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FI	1.645.752,01	1,51%
	109.347.105,50	



Gestor	Valor	% s/ Carteira
CAIXA DTVM	4844378050,00%	44,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4680089873,00%	42,80%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	669268273,00%	6,12%
ITAÚ UNIBANCO	328345121,00%	3,00%
TRÍGONO CAPITAL	2.480.540,32	2,27%
BANCO J. SAFRA S/A	1.645.752,01	1,51%
	109.347.105,50	



Análise da Situação das Instituições Financeiras

A análise aplicada as Instituições Financeiras referente a situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica foram identificadas:

Análise das Instituições Financeiras

Instituição Financeira	Res. CMN nº 3.922/10, Art. 15º	Patrimonial	Fiscal	Comercial	Jurídica
BANCO BRADESCO	✓	✓	✓	✓	✓
BANCO DAYCOVAL	✓	✓	✓	✓	✓
BANCO J. SAFRA S/A	✓	✓	✓	✓	✓
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	✓	✓	✓	✓	✓
CAIXA DTVM	✗	✓	✓	✓	✓
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	✓	✓	✓	✓	✓
ITAÚ UNIBANCO	✓	✓	✓	✓	✓
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
TRÍGONO CAPITAL	✗	✓	✓	✓	✓

Todas as Instituições Financeiras que compõe a carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA apresentam situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica adequados.

ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 25.078.994/0001-90)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A., devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira composta por ativos financeiros de renda fixa, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 7.701.081.218,58.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99,99% de cotas de fundo de investimentos, 46,16% do BB TOP RENDA FIXA IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 31.964.929/0001-64), 25,39% do BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.111.384/0001-69), 11,57% do BB TOP RENDA FIXA IMA-B 5 ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 33.570.884/0001-79), 8,57% do BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.442.078/0001-05) e 8,29% do BB TOP RENDA FIXA IMA-B 5+ FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 33.570.901/0001-78), que serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP RENDA FIXA IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 31.964.929/0001-64)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, que busquem acompanhar as variações de indicadores de referência do mercado de renda fixa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.779.222.977,33.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas em títulos públicos (78,08%), títulos públicos federais (21,90%) e derivativos (0,01%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.111.384/0001-69)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, de forma a acompanhar as variações diárias da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de 4.897.855.877,38.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (86,90%), operações compromissadas em título públicos (13,08%) e derivativos (0,02%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.442.078/0001-05)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) e ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC), onde deverá buscar o retorno dos investimentos através do sub-índice IMA-B – Índice de Mercado ANBIMA série B, conforme estabelecido na Resolução 3922/10 do CMN.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 7.081.253.604,41.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (90,80%), operações compromissadas em título públicos (9,17%) e outros (0,02%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Em 28 de janeiro de 2011, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante que informa a alteração dos horários limites de aplicação/resgate do fundo, sendo os horários limites de aplicação/resgate do fundo de 15:00 h para 17:00 h.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP RENDA FIXA IMA-B 5+ FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 33.570.901/0001-78)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, que busquem acompanhar as variações de indicadores de referência do mercado de renda fixa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 638.585.657,68.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (93,28%) e operações compromissadas em título públicos (6,71%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas

apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 13.322.205/0001-35)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas através de aplicações na totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) e ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC), onde buscará o retorno dos investimentos através do sub-índice IDKA 2A - Índice de Duração Constante ANBIMA, segmento 2 A.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 9.277.694.744,55.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (88,84%), operações compromissadas em títulos públicos (11,14%) e outros (0,02%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP (CNPJ: 03.543.447/0001-03)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A., devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo a aplicação dos recursos dos condôminos em carteira diversificada de ativos financeiros de longo prazo e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, observadas as limitações legais.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 6.458.635.592,00.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta exclusivamente pelas cotas do BB TOP RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 18.027.394/0001-37), que será devidamente apresentado a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 18.027.394/0001-37)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A., devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, que busquem acompanhar as variações de indicadores de referência do mercado de renda fixa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 8.599.412.801,85.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (84,18%), Operações Compromissadas em Títulos Públicos (15,79%) e outros (0,02%), representando 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 11.328.882/0001-35)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que têm em sua composição 100% em Títulos Públicos Federais, e atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3.922/10 do CMN, doravante denominados Fls.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 6.208.104.156,65.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% de cotas de fundos, sendo o BB IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA (CNPJ: 11.839.250/0001-36), onde serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA (CNPJ: 11.839.250/0001-36)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de

serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros de forma a acompanhar as variações diárias da taxa de juros doméstica.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 6.208.167.810,34.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (59,72%), Operação compromissada (40,18%) e derivativos (0,01%), que representam o montante de 99,90% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 23.215.097/0001-55)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995. Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

O fundo tem por objetivo buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER SOBERANO RENDA FIXA ATIVA (CNPJ: 10.948.555/0001-13).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 12.561.638.596,69.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta exclusivamente pelas cotas do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER SOBERANO RENDA FIXA ATIVA (CNPJ: 10.948.555/0001-13), que será apresentado adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER SOBERANO RENDA FIXA ATIVA (CNPJ: 10.948.555/0001-13)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995. Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 16.059.724.244,51.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (74,89%) e operações compromissadas em títulos públicos (25,11%). representando 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Conforme Assembleia Geral de Cotistas realizada em 4 de dezembro de 2020 foram deliberadas as seguintes matérias: i. Alteração da razão social do Fundo de “Fundo de Investimento Caixa Master Soberano Renda Fixa Longo Prazo” para “Fundo de Investimento CaixaMaster Soberano Renda Fixa Ativa”; ii. Exclusão da obrigatoriedade de manter prazo médio da carteira do Fundo superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. iii. Alteração da política de investimento do Fundo, de forma a expandir a exposição da carteira do Fundo ao risco de taxa de juros pré-fixadas e e/ou índices de preços; iv. Inclusão da previsão de que as deliberações das assembleias gerais poderão ser adotadas mediante processo de consulta formal, sem necessidade de reunião de Cotista, conforme artigo 71 da ICVM 555.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 27 de setembro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 07 de dezembro de 2021, foi deliberado e aprovado (i) Alteração do tipo de tratamento fiscal da carteira do FUNDO, que será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias (Longo Prazo). (ii) Se aprovado o item (i) acima, consequentemente, alteração da razão social do FUNDO, com a inclusão na sua denominação do sufixo “Longo Prazo”.

CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 14.386.926/0001-71)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Duração Constante ANBIMA – segmento IPCA 2A (IDkA IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 10.998.710.156,34.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (95,66%) e operações compromissadas (4,33%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 11.060.913/0001-10)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pela Caixa Econômica Federal, devidamente qualificada para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM nº 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice do Índice de Mercado ANBIMA - série B 5 - IMA-B 5.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 12.444.051.491,75.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (95,78%) e operações compromissadas em título públicos (4,22%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 10.740.670/0001-06)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pela Caixa Econômica Federal, devidamente qualificada para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM nº 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Renda Fixa de Mercado 1 - IRF-M 1, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 6.465.382.741,43.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (59,37%) e operações compromissadas em título públicos (40,62%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.588/0001-89)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A., devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros de renda fixa, buscando superar a rentabilidade do Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo – IPCA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.514.029.795,13.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo (99,99%), sendo 50,29% do BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.046.645/0001-81), 24,76% do BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.442.078/0001-05), 14,93% do BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.111.384/0001-69), 5,02% do BB TOP RENDA FIXA IMA-B 5 ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 33.570.884/0001-79) e 4,97% do BB TOP RENDA FIXA IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 31.964.929/0001-64), que serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.046.645/0001-81)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: nº 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, de forma a acompanhar as variações diárias da taxa do Certificado de Depósito Interfinanceiro - "CDI" ou da taxa SELIC.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 16.193.578.577,24.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (60,74%) e operações compromissadas em título públicos (38,02%), que representam o montante de 98,76% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevante publicado em 07 de abril de 2020 informando que em 07/04/2020 será alterado o valor de aplicação mínima inicial do Fundo para R\$ 10.000.000,00.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de maio de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- **BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.442.078/0001-05)**

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: nº 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários

como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) e ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC), onde deverá buscar o retorno dos investimentos através do sub-índice IMA-B – Índice de Mercado ANBIMA série B, conforme estabelecido na Resolução 3922/10 do CMN.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 7.081.253.604,41.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (86,10%), operações compromissadas em título públicos (13,88%) e outros (0,02%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Em 28 de janeiro de 2011, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante que informa a alteração dos horários limites de aplicação/resgate do fundo, sendo os horários limites de aplicação/resgate do fundo de 15:00 h para 17:00 h.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.111.384/0001-69)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, de forma a acompanhar as variações diárias da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.897.855.877,38.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (86,90%), Operação compromissada (13,08%) e derivativos (0,02%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Em 28 de janeiro de 2011, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante que informa a alteração dos horários limites de aplicação/resgate do fundo, sendo os horários limites de aplicação/resgate do fundo de 15:00 h para 17:00 h.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP RENDA FIXA IMA-B 5 ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 33.570.884/0001-79)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, que busquem acompanhar as variações de indicadores de referência do mercado de renda fixa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.118.125.354,83.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (90,80%), operações compromissadas em título públicos (9,17%) e outros (0,01%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP RENDA FIXA IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 31.964.929/0001-64)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: nº 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, que busquem acompanhar as variações de indicadores de referência do mercado de renda fixa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.779.222.977,33.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas em título públicos (78,08%), títulos públicos federais (21,90%) e derivativos (0,01%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.861.554/0001-22)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A., devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.098.154.442,70.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (86,68%), Operações Compromissadas (10,58%), Debêntures (2,71%) e outros (0,02%), representando 99,98% do patrimônio do fundo.

Em 28 de janeiro de 2011, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante que informa a alteração dos horários limites de aplicação/resgate do fundo, sendo os horários limites de aplicação/resgate do fundo de 15:00 h para 17:00 h.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP (CNPJ: 13.077.418/0001-49)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A., devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante a diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento, doravante denominados FIs.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 7.206.695.128,79.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100 % de cotas de fundos sendo o BB TOP DI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 03.504.023/0001-21), onde serão apresentados adequadamente a seguir.

Em 28 de setembro de 2018, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante que informa a reversão parcial de 40,66% da provisão para créditos de liquidação duvidosa provenientes da atual Série Única da 12ª Emissão de Debêntures Não Conversíveis (OIBRA2 com vencimento em 25 de fevereiro de 2035), oriundas do Plano de Recuperação Judicial da OI S.A., que integram direta ou indiretamente a carteira de ativos do Fundo.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP DI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 03.504.023/0001-21)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, de forma a acompanhar as variações diárias da taxa do Certificado de Depósito Interfinanceiro - "CDI" ou da taxa SELIC.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 12.019.960.646,07.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Operações Compromissadas (29,07%) e por Títulos Públicos (69,36%), que representam o montante de 98,43% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 29 de junho de 2016, informando a alteração do valor mínimo para resgate do FUNDO, com vigência a partir de 29/06/2016, inclusive: RESGATE VALOR ANTERIOR-R\$ 100, 00-VALOR A PARTIR DE 29/06/2016-R\$ 0,01.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 28.515.874/0001-09)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 1.085, de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como gestora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2.669, de 06 de dezembro de 1993.

O serviço de custódia dos ativos financeiros do fundo também é realizado pelo Banco Bradesco S.A., credenciado como pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório CVM nº 1.432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade que busque superar a variação do IPCA, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável. A rentabilidade do fundo irá variar conforme o comportamento da variação dos preços dos ativos financeiros e modalidades operacionais em carteira, sendo também impactada pelos custos e despesas do fundo e pela taxa de administração de 0,40% (quarenta centésimos por cento) ao ano.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.152.512.113,97.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% de cotas de fundos, sendo 61,07% no BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL II (CNPJ: 10.601.349/0001-32), 19,23% no BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B (CNPJ: 18.085.913/0001-13), 15,03% no BRAM INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M (CNPJ: 18.085.876/0001-43), 3,71% do BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS (CNPJ: 18.085.891/0001-91), 0,84% no BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 5 (CNPJ: 29.011.254/0001-97), 0,23% do BRAM H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO VOLGA (CNPJ: 09.241.756/0001-05), 0,06% do BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5 (CNPJ: 15.714.258/0001-27), 0,06% no BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2 (CNPJ: 24.022.566/0001-82), onde serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de novembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL II (CNPJ: 10.601.349/0001-32)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como gestora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2.669, de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 1.432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade que busque acompanhar as variações das taxas de juros praticadas no mercado de depósitos interbancários CDI, por meio da atuação preponderante no mercado de taxa de juros doméstica. A rentabilidade do Fundo variará conforme o comportamento da variação dos preços dos ativos financeiros e modalidades operacionais em carteira, sendo também impactada pelos custos e despesas do Fundo.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 5.073.308.471,92.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (75,80%) e Operações Compromissadas (24,21%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 28 de fevereiro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BRAM INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M (CNPJ: 18.085.876/0001-43)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como gestora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade que busque superar a variação do IRF-M, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, excluindo estratégias que impliquem risco de índices de preço, moeda estrangeira ou de renda variável. A rentabilidade do fundo será também impactada pelos custos e despesas do fundo.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 287.149.850,01.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (94,22%) e Operações Compromissadas (5,78%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de novembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B (CNPJ: 18.085.913/0001-13)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como gestora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade que busque superar a variação do IMA-B, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.623.640.159,75.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos (85,86%), cotas de fundo de investimentos (9%), do ETF BRADESCO IMA-B FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 34.081.054/0001-40), operações compromissadas em títulos públicos (2,62%), títulos privados (1,49%) e debêntures (1,04%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de janeiro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 22 de agosto de 2019 deliberou que, a partir do fechamento de 29 de agosto de 2019, sobre a: I) A alteração do regulamento do Fundo nos capítulos: Das Políticas de Investimento e dos Fatores de Risco; Da Administração e das Disposições Gerais; II) A cisão parcial do patrimônio líquido deste Fundo para o BRAM Fundo de Investimento Renda Fixa Index IMA-B, ambos administrados pelo Banco Bradesco S.A, bem como os procedimentos operacionais necessários para sua efetivação.

- BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 5 (CNPJ: 29.011.254/0001-97)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como

gestora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2.669, de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1.432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade através das oportunidades oferecidas, preponderantemente, pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas, pré-fixadas e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável, buscando acompanhar a variação do Índice de Duração Constante ANBIMA - IDKA Pré 5ª.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 116.825.604,24.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (83,07%) e operações compromissadas (17,62%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de abril de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada 01 de junho de 2018, deliberou, a partir do dia 07 de junho de 2018, a alteração do regulamento do fundo, no capítulo “Das Políticas de Investimento e dos Fatores de Risco”.

- BRAM H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO VOLGA (CNPJ: 09.241.756/0001-05)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo BANCO BRADESCO S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo também é o BANCO BRADESCO S.A.

(CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1432 de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo buscar proporcionar a valorização de suas Cotas por meio de uma Carteira composta, no mínimo, de 80% (oitenta por cento) em ativos financeiros de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à taxas de juros doméstica e/ou índice de preços, excluindo estratégias que impliquem em risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 714.226.648,75.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (64,70) e operações compromissadas (38,23%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5 (CNPJ: 15.714.258/0001-27)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo também é o Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1432 de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade que busque superar a variação do IMA-B 5, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco

de moeda estrangeira ou de renda variável. A rentabilidade do FUNDO será também impactada pelos custos e despesas do FUNDO.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.385.471.282,95.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (98,37) e operações compromissadas (1, 64%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de novembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Ata da Assembleia Geral realizada em 29 de janeiro de 2019, deliberou a partir do dia 31 de janeiro de 2019 a alteração do regulamento do Fundo no capítulo “Das Políticas de Investimento e Fatores de Risco”.

- BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS (CNPJ: 18.085.891/0001-91)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1432 de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade que busque superar a variação do IMA-B, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 656.313.627,03.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos (99,94%), operações compromissadas em títulos públicos (0,07%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de janeiro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 22 de agosto de 2019, deliberou, a partir do fechamento de 29 de agosto de 2019 sobre a: (I) a alteração do regulamento do fundo nos capítulos “Das Políticas de Investimento e dos Fatores de Risco”, “Da Administração” e “Das Disposições Gerais”; (II) a cisão parcial do patrimônio líquido deste fundo para o BRAM Fundo de Investimento Renda Fixa Index IMA-B, ambos administrados pelo Banco Bradesco S.A., bem como os procedimentos operacionais necessários para sua efetivação.

- BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2 (CNPJ: 24.022.566/0001-82)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1432 de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade através das oportunidades oferecidas, preponderantemente, pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas, pré-fixadas e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável, buscando acompanhar a variação do Índice de Duração Constante ANBIMA - IDKA Pré 2ª.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 300.397.636,27.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (86,62%) e operações compromissadas (13,35%), derivativos (0,05%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de maio de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA (CNPJ: 08.702.798/0001-25)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo Banco Bradesco S.A (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993, denominada como gestora.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco Bradesco S.A.,

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, buscando superar a variação do IMA-B, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 998.138.862,13.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta pelas cotas do BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B (CNPJ: 18.085.913/0001-13), que será apresentado adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de outubro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B (CNPJ: 18.085.913/0001-13)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como gestora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade que busque superar a variação do IMA-B, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.623.640.159,75.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos (85,86%), cotas de fundo de investimentos (9%), do ETF BRADESCO IMA-B FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 34.081.054/0001-40), operações compromissadas em títulos públicos (2,62%), títulos privados (1,49%) e debêntures (1,04%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de janeiro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 22 de agosto de 2019 deliberou que, a partir do fechamento de 29 de agosto de 2019, sobre a: I) A alteração do regulamento do Fundo nos capítulos: Das Políticas de Investimento e dos Fatores de Risco; Da Administração e das Disposições Gerais; II) A cisão parcial do patrimônio líquido deste Fundo para o BRAM Fundo de Investimento Renda Fixa Index IMA-B, ambos administrados pelo Banco Bradesco S.A, bem como os procedimentos operacionais necessários para sua efetivação.

CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP (CNPJ: 35.536.532/0001-22)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo buscar superar o IPCA por meio da aplicação dos recursos de no mínimo 95% do patrimônio líquido do Fundo em cotas de fundos de investimento no FI CAIXA MASTER RENDA FIXA ATIVO (CNPJ: 35.536.520/0001-06), não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 981.226.315,84.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta exclusivamente pelas cotas do FI CAIXA MASTER RENDA FIXA ATIVO (CNPJ: 35.536.520/0001-06), que será apresentado a seguir.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FI CAIXA MASTER RENDA FIXA ATIVO (CNPJ: 35.536.520/0001-06)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo superar o IPCA por meio da aplicação dos recursos em carteira diversificada de ativos financeiros indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços, não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.155.557.997,61.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos federais (96,85%) e operações compromissadas em títulos públicos (3,15%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP (CNPJ: 03.737.206/0001-97)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo buscar rentabilidade que acompanhe a variação do Depósito Interfinanceiro – DI (CETIP), por meio da aplicação dos recursos em carteira diversificada de ativos financeiros, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 8.765.736.063,59.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas em títulos públicos (39,10%), títulos públicos federais (29,90%), títulos privados (26,11%) e por debêntures (4,88%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA (CNPJ: 05.073.656/0001-58)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como “Renda Fixa”, os quais apliquem, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, ao fator de risco que dá nome à classe, buscando rentabilidade superior ao do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA, observado que a rentabilidade do FUNDO será impactada pelos custos e despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração, se houver.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 625.914.328,31.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99,68% em cotas de fundo de investimentos, sendo o ITAÚ VERSO B RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 19.452.065/0001-04) e 0,34% em cotas de fundo de investimentos, sendo o ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 11.419.818/0001-60), onde serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de novembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- ITAÚ VERSO B RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 19.452.065/0001-04)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela ITAÚ UNIBANCO S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 990, de 06 de julho de 1989. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o ITAÚ UNIBANCO S.A.

O fundo tem por objetivo aplicar, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, ao fator de risco que dá nome à classe, buscando rentabilidade superior ao do IMA-B.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 971.613.025,64.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (99,96%) e derivativos (0,01%), que representam o montante de 99,97% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Na Assembleia Geral Ordinária e Extraordinária, realizada em 30 de julho de 2019 deliberou alterações no regulamento do Fundo nos capítulos relativos às aplicações e aos resgates em dias sem expediente bancário, com efetivação a partir de 30 de setembro de 2019.

- ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 11.419.818/0001-60)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela ITAÚ UNIBANCO S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 990, de 06 de julho de 1989. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o ITAÚ UNIBANCO S.A.

O fundo tem por objetivo é aplicar seus recursos em ativos financeiros que buscam acompanhar a variação do Certificado de Depósito Bancário (“CDI”) ou da taxa Selic, de forma que, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) dos ativos financeiros componentes de sua carteira estejam atrelados a este parâmetro, direta ou indiretamente.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 29.967.079.957,53.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas em títulos públicos (73,87%) e títulos públicos federais (26,13%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de maio de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em 02 de setembro de 2019, em Assembleia Geral Extraordinária adequou no regulamento do fundo as Resoluções nº 4.661, de 25 de maio de 2018 e Resoluções nº 4.604, de 19 de outubro de 2017; inseriu a cláusula referente ao investimento conjunto e solidário por duas pessoas físicas para aquisição de uma mesma cota; alterou o capítulo referente as aplicações e resgates, com efetivação a partir de 01 de novembro de 2019.

A Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 12 de março de 2021, deliberou e aprovou a alteração da denominação de Itaú Verso A Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Fundo de Investimento para Itaú Verso A Renda Fixa Referenciado DI Fundo de Investimento, e a alteração no regulamento do Fundo no capítulo relativo à política de investimento, com efetivação a partir de 30 de março de 2021.

ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 21.838.150/0001-49)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº 990, de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A, conforme Ato Declaratório CVM nº 990, de 06 de julho de 1989.

O fundo tem por objetivo superar o IPCA por meio da alocação preponderante em cotas de fundos de investimento de “Renda Fixa” atrelados ao IMA e seus subíndices, podendo alocar também em fundos de investimento de “Renda Fixa” que seguem o CDI, observado que os fundos investidos pelo Fundo apenas alocam seus recursos em títulos públicos federais. A rentabilidade do Fundo será impactada em virtude dos custos e despesas do Fundo, inclusive taxa de administração.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.626.754.965,66.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por 100% de cotas de fundos de investimentos, sendo 99,82% do ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 32.265.550/0001-29) e 0,20% do ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 11.419.818/0001-60).

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de agosto de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Na Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 27 de dezembro de 2019, foi deliberada a alteração no Regulamento do Fundo nos capítulos relativos a remuneração, aplicações, resgates, adequação as Resoluções 4.661, de 25 de maio de 2019 e 4.604, de 19 de outubro de 2019 e outros aprimoramentos redacionais do Regulamento, sem a alteração das demais características do Fundo, com efetivação a partir de 26 de fevereiro de 2020.

- ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 32.265.550/0001-29)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela ITAÚ UNIBANCO S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 990, de 06 de julho de 1989. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o ITAÚ UNIBANCO S.A.

O fundo tem por objetivo aplicar, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, ao fator de risco que dá nome à classe, observado que a rentabilidade do fundo será impactada pelos custos e despesas do fundo, inclusive taxa de administração.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.622.276.027,28.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: títulos públicos federais (52,20%) e operações compromissadas em títulos públicos (47,81%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 11.419.818/0001-60)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela ITAÚ UNIBANCO S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 990, de 06 de julho de 1989. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o ITAÚ UNIBANCO S.A.

O fundo tem por objetivo é aplicar seus recursos em ativos financeiros que buscam acompanhar a variação do Certificado de Depósito Bancário (“CDI”) ou da taxa Selic, de forma que, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) dos ativos financeiros componentes de sua carteira estejam atrelados a este parâmetro, direta ou indiretamente.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 29.967.079.957,53.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: operações compromissadas em títulos públicos (73,87%) e títulos públicos federais (26,13%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de maio de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas, realizada em 02 de setembro de 2019, foi deliberado a alteração no regulamento nos capítulos relativos à adequação das resoluções 4.661 e 4.604, aplicação e resgates, outros aprimoramentos e consolidação do texto, com efetivação em 1 de novembro de 2019.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 12 de março de 2021, foi deliberado e aprovado a alteração de Itaú Verso A Renda Fixa Referenciado D Longo Prazo de Investimento para Itaú Verso A Renda Fixa Referenciado Di Fundo De Investimento, e a alteração no regulamento do Fundo.

BB GOVERNANÇA FI AÇÕES (CNPJ: 10.418.335/0001-88)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou de performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM pelo Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo compor uma carteira de ativos financeiros que reflita o comportamento da carteira teórica do Índice de Governança Corporativa Trade (IGC-T), divulgado pela B3.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 994.621.415,62.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (98,80%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,70%), representando 99,50% do patrimônio do fundo.

Foram localizados 2 fatos relevantes, publicados em 05 de novembro de 2019 e 10 de setembro de 2020 (referente à alteração dos valores de movimentação e permanência no Fundo).

Foi localizado Fato Relevante publicado em 17 de agosto de 2021 informando que, no exercício do seu dever de diligência e fidúcia e no intuito de prevenir e resguardar eventuais direitos, o FUNDO aderiu ao procedimento arbitral de cunho indenizatório em face de VALE S.A., instaurado junto à Câmara de Arbitragem do Mercado (CAM – B3).

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 00.822.059/0001-65)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou de performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM pelo Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento (FI) direcionados para assumir posições em ações de empresas rentáveis a médio e longo prazo, priorizando operações de giro em ativos financeiros de alta liquidez, apresentando uma carteira de ativos financeiros que supere o comportamento da carteira da carteira teórica do IBOVESPA – Índice Bovespa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 170.073.811,64.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta exclusivamente pelas cotas do BB TOP AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 08.973.963/0001-83), que será apresentado a seguir.

Foram localizados 2 fatos relevantes, publicados em 05 de novembro de 2019 (informando a redução, a partir desta data, da taxa de administração do Fundo para um por cento ao ano) e 10 de setembro de 2020 (referente à alteração dos valores de movimentação e permanência no Fundo).

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 08.973.963/0001-83)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou de performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de

serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM pelo Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ações de empresas rentáveis a médio e longo prazo, priorizando operações de giro em ativos de alta liquidez, compondo uma carteira de ativos financeiros que supere o comportamento da carteira das carteiras teóricas do IBOVSPA – Índice Bovespa, do Ibrx – Índice Brasil e do Ibrx-50 – Índice Brasil 50.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 170.090.427,66.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (92,96%), operações compromissadas (3,18%) e derivativos (0,34%), representando 96,48% do patrimônio do fundo.

Foi localizado 1 fato relevante, publicado em 14 de novembro de 2017, informando que, no exercício do seu dever de diligência e fidúcia e no intuito de prevenir e resguardar eventuais direitos, o Fundo aderiu ao procedimento arbitral de cunho indenizatório em face de Petróleo Brasileiro S.A. – PETROBRAS, instaurado junto à Câmara de Arbitragem do Mercado (CAM – B3).

Foi localizado Fato Relevante publicado em 17 de agosto de 2021 informando que, no exercício do seu dever de diligência e fidúcia e no intuito de prevenir e resguardar eventuais direitos, o FUNDO aderiu ao procedimento arbitral de cunho indenizatório em face de VALE S.A., instaurado junto à Câmara de Arbitragem do Mercado (CAM – B3).

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BRDESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES (CNPJ: 03.394.711/0001-86)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1085, de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do fundo é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), devidamente credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669, de 06 de dezembro de 1993.

A custódia dos ativos financeiros do fundo é realizada pelo ADMINISTRADOR, devidamente credenciado como custodiante de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório CVM nº 1432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo obter rentabilidade que busque acompanhar as variações do Índice da Bolsa de Valores de São Paulo (Ibovespa), através da atuação do mercado de ações. A rentabilidade do Fundo variará conforme o comportamento do Índice da Bolsa de Valores de São Paulo (Ibovespa) sendo também impactada pelos custos e despesas do Fundo e pela taxa de administração de 0,50% (cinquenta centésimos por cento) ao ano.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 301.298.313,12.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (99,25%), operações compromissadas em títulos públicos (0,62%) e outros (0,01%), representando 99,87% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevando, publicado em 19 de março de 2018, informando que o Fundo aderiu ao procedimento arbitral indenizatório proposto em face da Petróleo Brasileiro S.A – Petrobras, instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado – CAM B3.

Foi localizado Fato Relevando, publicado em 02 de setembro de 2021, informando que, nos termos do artigo 60, da Instrução CVM nº 555/14, observando o dever de diligência e fidedignidade, aderiu ao procedimento arbitral indenizatório proposto em face da Vale S.A., instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado – CAM B3.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 18 de junho de 2018 deliberou, a partir de 9 de agosto de 2018, a alteração do regulamento do Fundo, nos capítulos “Das Políticas de Investimentos e dos Fatores de Risco”, “Da Administração”, “Da Remuneração dos Serviços de Administração e Demais Despesas do Fundo” e “Da Emissão e do Resgate de Cotas”.

O Instrumento Particular de Alteração do Regulamento do Fundo realizado em 17 de maio de 2019 deliberou, a partir de 27 de maio de 2019, a adaptação do prazo para pagamento de resgates aos cotistas do Fundo, o qual será reduzido em 1 dia.

BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES (CNPJ: 29.258.294/0001-38)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso ou saída, cobradas pelo fundo.

Será cobrada taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do fundo, sobre a rentabilidade que exceder a variação de 100% IBOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do fundo, inclusive taxa de administração.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos – Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM como custodiante, de acordo com o Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo adquirir cotas de fundos de investimento em ações cujos ativos financeiros buscarão retorno por meio da seleção de empresas cujo valor das ações negociadas esteja abaixo de seu potencial e com desconto em relação à sua história e a seus pares (estratégia valor).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.098.659.963,05.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99,7% das cotas de fundo de investimentos, sendo o BB TOP AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 29.258.286/0001-91), onde será apresentado adequadamente a seguir.

Em 05 de novembro de 2019, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante informando alteração dos valores de aplicação inicial, aplicação subsequente, resgate mínimo e saldo mínimo de permanência no fundo.

Em 10 de setembro de 2020, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante informando a alteração dos valores de movimentação do fundo.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 29.258.28 6/0001-91)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou de performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO DO BRASIL S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM pelo Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo buscar retorno por meio da seleção de empresas cujo valor das ações esteja sendo negociadas abaixo de seu potencial e com desconto em relação a sua história e a seus pares (estratégia valor).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.195.946.905,14.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (64,80%), operação compromissada (12,68%), cotas de fundos de investimentos (10,21%), sendo 5,77% do (CNPJ: 10.406.511/0001-61), 4,43% do (CNPJ: 34.606.480/0001-50), Brazilian Depositary Receipts (2,35%), títulos públicos federais (1,12%) e derivativos (0,17%), que representam o montante de 91,23% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em 20 de maio de 2021, em Assembleia Geral Extraordinária, foram deliberados: (i) inclusão, no quadro da composição da carteira, da possibilidade de aplicação em Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I até o limite de 20%; (ii) inclusão da possibilidade de o fundo aplicar até 20% do seu Patrimônio Líquido em ativos financeiros no exterior e (iii) alteração e reordenamento dos fatores de risco. Tais deliberações entraram em vigor em 21 de maio de 2021.

BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES (CNPJ: 14.213.331/0001-14)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance, cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM como custodiante, de acordo com o Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento (FIs) que componham uma carteira de ações emitidas por empresas que apresentem histórico de pagamento de bons dividendos/juros sobre capital em relação à média do mercado de ações, observadas as limitações legais e regulamentares em vigor.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 351.114.622,38.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta exclusivamente pelas cotas do BB TOP AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 13.079.650/0001-16), que será apresentado adequadamente a seguir.

Em 19 de novembro de 2019, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante informando a redução, a partir desta data, da taxa de administração do Fundo para 1,00% (um por cento) ao ano.

Em 10 de setembro de 2020, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante informando a alteração dos valores de movimentação do fundo.

E no dia 31 de março de 2021, através de um novo Fato Relevante, a administradora informa que em 01 de abril de 2021 será realizada a incorporação do fundo BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS PRIVATE FIC FI, CNPJ: 04.312.909/0001-36, pelo fundo BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI, CNPJ: 14.213.331/0001-14, de acordo com aprovação do processo de consulta formal encerrado às 17 horas do dia 10 de fevereiro de 2021.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 13.079.650/0001-16)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou de performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM pelo Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus participantes rentabilidade e liquidez, mediante a aplicação dos recursos em ações de empresas que apresentem histórico de pagamento de bons dividendos/juros sobre capital em relação à média do mercado de ações, observadas as limitações legais e regulamentares em vigor.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 352.170.527,09.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: ações (93,06%), operação compromissada (3,07%) e outros (0,07%), que representam o montante de 96,20% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia realizada em 15 de março de 2021, foram deliberadas: a) Inclusão de Parágrafo Único no Artigo 3º, que trata do enquadramento de público RPPS e EFPC; b) Inclusão do item 6 - Brazilian Depositary Receipts classificados como nível II e nível III e do item 7 - Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I, no Quadro Composição da Carteira do Artigo 12 do Regulamento; c) Inclusão dos parágrafos 2, 3 e 4 no Artigo 12, que trata das vedações impostas ao público RPPS e EFPC; d) Inclusão do parágrafo 7 no Artigo 12, possibilitando a aplicação de até 20% do Patrimônio Líquido do FUNDO em ativos financeiros negociados no exterior; e) Alteração e reordenamento dos fatores de risco do FUNDO do Artigo 15 do Regulamento. Tais deliberações entraram em vigor em 15 de março de 2021.

BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 07.882.792/0001-14)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso ou saída, cobradas pelo fundo.

Será cobrada taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do fundo, sobre a rentabilidade que exceder a variação de 100% IBOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do fundo, inclusive taxa de administração.

O Fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente credenciada pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de Registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do Fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo adquirir cotas de fundos de investimento (FIs) cujos ativos financeiros componham uma carteira de ações emitidas por empresas brasileiras pertencentes a diversos setores da economia, selecionados através de criteriosa escolha, de forma a buscar as melhores oportunidades no mercado de bolsa nacional.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.417.181.864,81.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta exclusivamente pelas cotas do BB TOP AÇÕES QUANTITATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.877.986/0001-21), que será apresentado adequadamente a seguir.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 10 de setembro de 2020, informando que nesta data foram alterados os valores de movimentação do Fundo.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BB TOP AÇÕES QUANTITATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.877.986/0001-21)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, performance ou saída, cobradas pelo fundo.

O Fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente credenciada pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de Registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do Fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo compor uma carteira de ações emitidas por empresas brasileiras pertencentes a diversos setores da economia, selecionados através de criteriosa escolha, de forma a buscar as melhores oportunidades no mercado de bolsa nacional.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.932.840.956,14.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (57,59%), cotas de fundos de investimento (15,26% - sendo 9,52% do ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 10.406.511/0001-61), 3,42% do BB ETF IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 34.606.480/0001-50) e 2,30% do IT NOW IFNC FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ:11.961.094/0001-81), operação compromissada (13,61%), Brazilian Depositary Receipts (4,33%) e derivativos (0,20%), representando 90,98% do patrimônio do fundo.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 10 de setembro de 2020 informando que, nesta data, foram alterados os valores de movimentação do Fundo.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em 28 de maio de 2021, em Assembleia Geral Extraordinária foram deliberados: i) Artigo 3º - Inclusão do parágrafo único, informando que o fundo deverá observar, no que couber, as Resoluções CMN 3922/10 e 4661/18; ii) Artigo 11 – Alteração da Política de investimento, conforme abaixo: a) Inclusão do item 6, no quadro da composição da carteira, da possibilidade de aplicação em BDR classificados como nível 1 até o limite de 20%; b) Inclusão do parágrafo 5º, para inclusão da possibilidade de o fundo aplicar até 20% do seu Patrimônio Líquido em ativos financeiros no exterior; c) Inclusão do parágrafo 6º, referente às vedações ao fundo. iii) Artigo 14 – Alteração e reordenamento dos fatores de risco. Tais deliberações entraram em vigor em 31 de maio de 2021.

BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES (CNPJ: 06.988.623/0001-09)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ: 00.066.670/0001-00), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 3067, de 06 de setembro de 1994.

A gestão da carteira do fundo é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), devidamente credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669, de 06 de dezembro de 1993.

A custódia dos ativos financeiros do fundo é realizada pelo ADMINISTRADOR, devidamente credenciado como custodiante de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório CVM nº 1432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus COTISTAS, rentabilidade através de investimentos em carteira de ações, no mínimo, 85% (oitenta e cinco por cento) em ações de empresas que não estejam incluídas entre as 25 maiores participações do IBrX - Índice Brasil, ou seja, ações de empresas com relativamente baixa capitalização de mercado. Adicionalmente, os 15% remanescentes poderão ser investidos em ações de maior liquidez ou capitalização de mercado, desde que não estejam incluídas entre as dez maiores participações do referido índice.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.419.483.989,90.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (93,88%) e operações compromissadas em títulos públicos (6,26%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 03 de dezembro de 2018 deliberou, a partir de 21 de janeiro de 2019 sobre: I) a alteração do regulamento do Fundo nos capítulos: “Das Políticas de Investimento e dos Fatores de Risco”, “Da Administração”, “Da Remuneração dos Serviços de Administração e Demais Despesas do Fundo”, “Da Emissão e do Resgate de Cotas” e II) a incorporação, por este Fundo (Fundo Incorporador), do Bradesco Fundo de Investimento de Ações Infraestrutura (Fundo Incorporado), ambos administrados pela Bem DTVM Ltda.

O Instrumento Particular de 17 de maio de 2019 deliberou, a partir de 27 de maio de 2019, a adaptação do prazo de pagamento de resgates aos cotistas do Fundo, o qual foi reduzido em um dia.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de setembro de 2019 deliberou, a partir de 21 de outubro de 2019, alteração da denominação social do Fundo de: Bradesco Fundo de Investimento em Ações Small Cap Plus para Bradesco Fundo de Investimento em Ações MID Small Caps e alteração nos capítulos “Do Fundo” e “Da Administração”.

BRADESCO SELECTION FI AÇÕES (CNPJ: 03.660.879/0001-96)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório CVM nº 1085, de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do fundo é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), devidamente credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669, de 06 de dezembro de 1993.

A custódia dos ativos financeiros do fundo é realizada pelo ADMINISTRADOR, devidamente credenciado como custodiante de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório CVM nº 1432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, buscando superar a variação do IMA-B, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 535.410.218,31.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (96,19%) operações compromissadas em títulos públicos (2,49%) e cotas de fundo de investimentos (1,24% das cotas do ETF BRADESCO IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVB11 (CNPJ: 32.203.211/0001-18), que será apresentado adequadamente a seguir, representando 99,92% do patrimônio do fundo.

Foi localizado um Fato Relevante, publicado em 09 de março de 2018, informando que, nos termos do Art. 60, da Instrução CVM nº 555/2014, observando o dever de diligência e fidúcia, aderiu ao procedimento arbitral indenizatório proposto em face da Petróleo Brasileiro S.A. – Petrobras, instaurado perante a Câmara Arbitral do Mercado – CAM B3.

Foi localizado Fato Relevando, publicado em 02 de setembro de 2021, informando que observando o dever de diligência e fidúcia, aderiu ao procedimento arbitral indenizatório proposto em face da Vale S.A., instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado – CAM B3.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral realizada em 03 de dezembro de 2020, foi aprovada: a substituição do administrador para o Banco Bradesco S.A., inscrito no CNPJ sob o nº 60.746.948/0001-12, bem

como a deliberação sobre as condições operacionais para tal substituição tais alterações passaram a vigorar a partir do fechamento das operações do dia 07 de dezembro de 2020.

- ETF BRADESCO IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVB11 (CNPJ: 32.203.211/0001-18)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1085 de 30 de agosto de 1989.

A gestão da carteira do FUNDO é exercida pela BRAM - Bradesco Asset Management S.A. Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários (CNPJ: 62.375.134/0001-44), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório nº 2669 de 06 de dezembro de 1993, denominada como gestora.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco Bradesco S.A. O responsável pelo serviço de custódia dos ativos financeiros do Fundo, é realizado pelo Banco Bradesco S.A, credenciado como custodiante de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, pelo Ato Declaratório CVM nº 1.432 de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo investir em carteira de títulos em busca de rentabilidade, que antes da dedução das taxas e despesas, reproduzam a variação do Índice Ibovespa, calculado pela B3.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.190.407.736,13.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (99,62%), títulos públicos (0,07%) e derivativos (0,01%), que representam o montante de 99,29% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 30 de julho de 2020, informando que a Assembleia Geral de Cotistas, que seria realizada excepcionalmente por meio eletrônico em 29 de julho de 2020 a fim de deliberar sobre a aprovação das demonstrações financeiras auditadas do Fundo referentes ao exercício social encerrado em de 31 de março de 2020, não se realizou em razão do não comparecimento de Cotistas na conferência telefônica e do não recebimento de orientação de voto digitalizada por correio eletrônico.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 29 de junho de 2021, convidando os cotistas para participar da Assembleia Geral Ordinária de Cotistas do Fundo, a ser realizada em 15 de julho de 2021, a fim de deliberar sobre as Demonstrações Financeiras, relativamente ao exercício social findo em 31 de março de 2021.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral realizada em 03 de dezembro de 2020 foi aprovada a substituição do administrador para o Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), bem como a deliberação sobre as condições operacionais para tal substituição. Tais alterações passaram a vigorar a partir do fechamento das operações do dia 07 de dezembro de 2020.

CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 30.068.169/0001-44)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas de fundos de investimento, que invistam em ativos financeiros e modalidades operacionais conforme a regulamentação em vigor, e dentro dos limites estabelecidos em sua política de investimento, não constituindo tal objetivo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 506.222.631,32.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por 100% de cotas do Fundo de Investimento, sendo 99,58% de cotas do AÇÕES CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO (CNPJ: 30.036.209/0001-76) e 0,63% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), que serão apresentados a seguir.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral de Cotista realizada em 08 de junho de 2021 aprovou: (i) Alteração da razão social do Fundo com a inclusão do termo “Quantitativo”, como segue: De: “Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento de Ações Caixa Brasil Ações Livre” Para: “Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento de Ações Caixa Brasil Ações Livre Quantitativo”. (ii) Adequação redacional no público alvo, de acordo com o padrão utilizado pela Administradora.

A Assembleia Geral de Cotista realizada em 08 de julho de 2021 aprovou: (i) Adequação redacional nos fatores de Risco do Fundo, referente ao “Risco proveniente do uso de derivativos”, de forma a esclarecer que, mesmo que os instrumentos de derivativos possam ser utilizados para proteger as posições do Fundo, esta proteção pode não ser perfeita ou suficiente para evitar perdas.

Em Assembleia Geral de Cotista realizada em 8 de outubro de 2021, foi aprovada a transferência do serviço de gestão da carteira do Fundo para a Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 42.040.639/0001- 40.

- FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE (CNPJ: 30.036.209/0001-76)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em ativos financeiros e modalidades operacionais conforme a regulamentação em vigor, e dentro dos limites estabelecidos em sua política de investimento, não constituindo tal objetivo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 732.439.572,24.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (98,92%) e fundos de investimento (0,90%), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO, representando 99,82% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Assembleia Geral de Cotista realizada em 08 de junho de 2021 aprovou: (i) Alteração da razão social do Fundo com a inclusão do termo “Quantitativo”, como segue: De: “Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento de Ações Caixa Brasil Ações Livre” Para: “Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento de Ações Caixa Brasil Ações Livre Quantitativo”. (ii) Adequação redacional no público-alvo, de acordo com o padrão utilizado pela Administradora.

Assembleia Geral de Cotista realizada em 08 de julho de 2021 aprovou: (i) Adequação redacional nos fatores de Risco do Fundo, referente ao “Risco proveniente do uso de derivativos”, de forma a esclarecer que, mesmo que os instrumentos de derivativos possam ser utilizados para proteger as posições do Fundo, esta proteção pode não ser perfeita ou suficiente para evitar perdas.

Em Assembleia Geral de Cotista realizada em 8 de outubro de 2021, foi aprovada a transferência do serviço de gestão da carteira do Fundo para a Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 42.040.639/0001- 40.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.231.328.576,72.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (90,94%) e operações compromissadas em títulos públicos (8,61%), representando 99,55% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Conforme Assembleia Geral de Cotista realizada em 16 de novembro de 2020 foram deliberadas as seguintes alterações: I. Inclusão da classificação do Fundo, de acordo com o padrão utilizado pela Administradora. II. Alteração da política de investimento do Fundo, de forma a limitar a exposição da carteira do Fundo apenas ao risco de taxa de juros pós-fixadas. III. Artigo 6º: adequação no objetivo do fundo, com a exclusão da obrigatoriedade dos títulos públicos federais que compõem a carteira do Fundo sejam indexados a taxas de juros prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI); IV. Inclusão da previsão de que as deliberações da assembleia geral podem ser adotadas mediante processo de consulta formal, sem necessidade de reunião de Cotista, conforme artigo 71 da ICVM 555.

Em Assembleia Geral de Cotista realizada em 27 de setembro de 2021, foi aprovada a transferência do serviço de gestão da carteira do Fundo para a Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 42.040.639/0001- 40.

ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES (CNPJ: 16.718.302/0001-30)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como "Ações", os quais investem em ativos financeiros que tenham como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, observado que a rentabilidade do Fundo será impactada em virtude dos custos e despesas do Fundo, inclusive taxa de administração.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.169.136.968,28.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta 100% por cotas de fundos de investimentos, sendo 99,83% de cotas do ITAÚ MASTER MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 42.264.583/0001-08), 0,16% do ITAÚ CAIXA AÇÕES – FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.096.546/0001-37) e 0,04% do ITAÚ MOMENTO II AÇÕES – FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 10.263.612/0001-20), que serão apresentados a seguir.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 06 de novembro de 2019 informando, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, publicada em 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 07 de novembro de 2019.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de novembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária ocorrida em 25 de novembro de 2019, foram deliberadas alterações no regulamento nos capítulos relativos à política de investimento, aplicação, resgates, limites por emissor e outros aprimoramentos, para refletir as alterações aprovadas na Assembleia, o qual passará a vigorar, a partir de 22 de janeiro de 2020.

- ITAÚ MASTER MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 42.264.583/0001-08)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ativos financeiros que tenham como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, observado que a rentabilidade do FUNDO será impactada em virtude dos custos e despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.169.424.795,47.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (58,94%), investimento no exterior (26,43%), outros (7,72%), operação compromissada (7,01%), derivativos (0,45%) e títulos federais (0,18%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

Não foram encontradas informações a respeito do parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- ITAÚ CAIXA AÇÕES – FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.096.546/0001-37)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como “Ações”, os quais investem em ativos financeiros que tenham como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, observado que a rentabilidade do Fundo será impactada em virtude dos custos e despesas do Fundo, inclusive taxa de administração.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 266.387.245,21.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (36,81%), cotas de fundo de investimento (32,09%), do IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 21.407.758/0001-19) e títulos públicos federais (29,20%), representando o montante de 98,10% do patrimônio do fundo.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 12 de janeiro de 2019 informando que o fundo aderiu a um procedimento arbitral de natureza indenizatória proposto em face da PETROBRAS – Petróleo Brasileiro S.A. perante a Câmara de Arbitragem do Mercado da B3. O Fundo informa, ainda, que a decisão de aderir ao procedimento arbitral será levada à ratificação de seus cotistas

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de abril de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 29 de agosto de 2019, deliberou adequação as resoluções 4.661, de 25 de maio de 2018, que dispõe sobre as diretrizes de aplicação dos recursos garantidores dos planos administrados pelas entidades fechadas de previdência complementar e 4.604, de 19 de outubro de 2017 que dispõe sobre as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social instituídos pela União, Estado, Distrito Federal e Municípios, e a alteração no Regulamento do Fundo nos capítulos relativos as aplicações e resgate em dias sem expediente bancário e outros aprimoramentos redacionais do Regulamento do Fundo, em conformidade com a Instrução CVM 555/14, sem a alteração das demais características, com efetivação a partir de 30/10/2019.

- ITAÚ MOMENTO II AÇÕES – FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 10.263.612/0001-20)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como “Ações”, os quais investem em ativos financeiros que tenham como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, observado que a rentabilidade do Fundo será impactada em virtude dos custos e despesas do Fundo, inclusive taxa de administração.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.134.557.119,56.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (75,63%), operações compromissadas (15,95%), outros (9,38%), derivativos (0,58%) e títulos públicos federais (0,17%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 02 de agosto de 2021, informando que aderiu a um procedimento arbitral de natureza indenizatória proposto em face da VALE S.A., instaurado na Câmara de Arbitragem do Mercado da B3.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de agosto de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 01 de novembro de 2019, deliberou alteração no regulamento nos capítulos relativos adequar o inteiro teor do Regulamento as Resoluções: 4.661, de 25 de maio de 2018, que dispõe sobre as diretrizes de aplicação dos recursos garantidores dos planos administrados pelas entidades fechadas de previdência complementar e 4.604, de 19 de outubro de 2017 e outros aprimoramentos redacionais do Regulamento do Fundo, com efetivação em 04 de novembro de 2019.

Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 03 de janeiro de 2020, deliberou alteração no regulamento nos capítulos relativos à limites por ativo e outros aprimoramentos, com efetivação em 08 de janeiro de 2020.

Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 28 de abril de 2021, aprovou a cisão parcial deste Fundo, com versão de parcela patrimonial cindida para o fundo Itaú Momento 2 Ações Fundo de Investimento, inscrito no CNPJ sob nº 40.616.199/0001-00, também administrado pelo Itaú Unibanco S.A., com efetivação em 04/06/2021, tendo como base a posição de fechamento do dia 02/06/2021.

Em 17 de setembro de 2021, em Assembleia Geral Extraordinária, foi deliberada alteração na razão social do fundo de Itaú Momento Ações Fundo de Investimento para Itaú Momento II Ações Fundo de Investimento e aprovar a cisão parcial deste fundo para Itaú Master Momento Ações Fundo de Investimento e aprimoramentos redacionais, com efetivação a partir do fechamento de 19 de janeiro de 2021.

SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES (CNPJ: 14.476.729/0001-43)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA (CNPJ: 06.947.853/0001-11), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 14.105, de 23 de fevereiro de 2015.

Ele é gerido pelo BANCO J. SAFRA S/A (CNPJ: 03.017.677/0001-20), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 11.124, de 24 de junho de 2010.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o BANCO SAFRA S/A (CNPJ: 58.160.789/0001-28), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Custódia de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.390, de 13 de junho de 2001.

O fundo tem por objetivo atuar no sentido de propiciar aos seus condôminos valorização de suas cotas mediante a aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações e/ou cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento em ações que invistam em ações de empresas com grande potencial de valorização, boa qualidade do management, governança corporativa, posicionamento estratégico e que apresentem vantagem. Não possui obrigatoriamente o compromisso em uma estratégia específica.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 270.496.836,35.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por 99,89% de cotas de fundo de investimentos, do SAFRA EQUITY PORTFOLIO MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 14.476.736/0001-45), que será apresentado adequadamente a seguir.

Não foi localizado Fato Relevante.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 10 de dezembro de 2018, foram aprovadas: (i) a mudança da política de investimento do Fundo a fim de adequá-lo aos limites e vedações da Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 3.922/10, que dispõe sobre os investimentos de recursos administrados por Regimes Próprios de Previdência; e (ii) a exclusão dos itens do regulamento que tratam da possibilidade do Fundo investir no exterior. As alterações entraram em vigor a partir de 16 de janeiro de 2019.

Em Assembleia Geral de Cotistas, realizada em 11 de fevereiro de 2019, foram aprovadas: (i) a transferência da gestão do Fundo da Safra Asset Management Ltda., inscrita no CNPJ: 62.180.047/0001-31 para o Banco J. Safra S.A., inscrito no CNPJ: 03.017.677/0001-20; e (ii) a consolidação do texto do Regulamento para refletir as alterações deliberadas na Assembleia, o qual passará a vigorar a partir da data da transferência. As alterações entraram em vigor a partir de 15 de fevereiro de 2019.

Em Instrumento Particular de Alteração de Fundo de Investimento datado em 17 de maio de 2019 foi aprovado a alteração no regulamento do prazo de liquidação e pagamento de resgates, os quais serão antecipados em um dia, mantendo-se inalteradas as demais condições. A alteração entrou em vigor a partir de 27 de maio de 2019.

- SAFRA EQUITY PORTFOLIO MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 14.476.736/0001-45)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA (CNPJ: 06.947.853/0001-11), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 14.105, de 23 de fevereiro de 2015.

Ele é gerido pelo SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA. (CNPJ: 62.180.047/0001-31), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 11.062, de 21 de maio de 2010.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o BANCO SAFRA S/A (CNPJ: 58.160.789/0001-28), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Custódia de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.390, de 13 de junho de 2001.

O fundo tem por objetivo atuar no sentido de propiciar aos seus cotistas, valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos, preponderantemente, em ações de empresas com grande potencial de valorização, boa qualidade do management, governança corporativa, posicionamento estratégico e que apresentem vantagem. O FUNDO não possui obrigatoriamente o compromisso de concentração em uma estratégia específica.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 367.723.416,94.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (95,15%), debêntures (3,24%) e operação compromissada (1,96%), representando o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não foi localizado Fato Relevante.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 10 de dezembro de 2018, foi aprovada a mudança da política de investimentos do Fundo a fim de adequá-los aos limites e vedações da Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 3.922/10 que dispõe sobre os investimentos de recursos administrados por Regimes Próprios de Previdência. A alteração entrou em vigor a partir de 16 de janeiro de 2019.

Em Instrumento Particular de Alteração de Fundo de Investimento datado em 17 de maio de 2019 foi aprovado a alteração no regulamento do prazo de liquidação e pagamento de resgates, os quais serão antecipados em um dia, mantendo-se inalteradas as demais condições. A alteração entrou em vigor a partir de 27 de maio de 2019.

TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 41.196.740/0001-22)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso ou saída cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 17.552, de 05 de dezembro de 2019, e gerido pela TRÍGONO CAPITAL LTDA. (CNPJ: 28.925.400/0001-27), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 16.129 de 05 de fevereiro de 2018.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90) credenciado como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 1.085 de 30 de agosto de 1989.

O fundo tem por objetivo o de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em cotas do TRIGONO DELPHOS INCOME FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES, inscrito no CNPJ/MF sob o número 29.088.410/0001-18 (“Fundo Investido”).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 51.396.648,42.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% em cotas de fundos de investimentos, sendo 100% do TRIGONO DELPHOS INCOME FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 29.088.410/0001-18) e 0,007% do DAYCOVAL TÍTULOS PÚBLICOS VI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO (CNPJ: 36.954.526/0001-58), que serão devidamente apresentados a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

Não foram encontradas informações a respeito do parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- TRIGONO DELPHOS INCOME FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 29.088.410/0001-18)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 8.695, de 20 de março de 2006.

Ele é gerido pela TRÍGONO CAPITAL LTDA. (CNPJ: 28.925.400/0001-27), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 16.129 de 05 de fevereiro de 2018.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o Banco BTG Pactual S.A. (CNPJ: 30.306.294/0001-45) credenciado como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo investir predominantemente em ações de empresas que possuem histórico consistente de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital próprio e que possuam potencial para no futuro remunerar seus acionistas através desses proventos, sem restrição a nenhum setor de atividade econômica na seleção de ações. O Fundo também busca investir em ações de empresas com potencial de proporcionar ganhos de capital através da valorização no longo prazo, observando critérios de boa governança, desenvolvimento social e respeito ao meio ambiente, os quais a Gestora também envidará os melhores esforços para contribuir na progressão das empresas investidas.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 393.811.191,60.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (98,77%) e operação compromissada (2,83%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não foram localizados Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Quotistas realizada em 4 de novembro de 2019, foi aprovada a adaptação do regulamento do fundo à Resolução nº 4661, de 25 de maio de 2018, e à Resolução 3.922, de 25 de novembro de 2010, do Conselho Monetário Nacional, de modo a alterar o regulamento em sua integralidade. Tal alteração passou a fazer efeito a partir do fechamento do dia 4 de dezembro de 2019.

- DAYCOVAL TÍTULOS PÚBLICOS VI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO (CNPJ: 36.954.526/0001-58)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 17.552, de 05 de dezembro de 2019.

Ele é gerido pela Daycoval Asset Management Administração de Recursos LTDA (CNPJ: 72.027.832/0001-02), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela

Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 8056 de 02 de dezembro de 2004.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também é o Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90) credenciado como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 1.085 de 30 de agosto de 1989.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, exclusivamente, por meio de aplicações de seus recursos em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos, observado o disposto no Artigo 111 da Instrução CVM nº 555/14, conforme alterada.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 378.836.127,17.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% por operações compromissadas.

Não há Fatos Relevantes publicados.

Não foram encontradas informações a respeito do parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis.

Não há informações sobre públicas disponíveis no site da CVM que comprove a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 36.671.926/0001-56)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso ou saída cobradas pelo fundo.

O Fundo possui taxa de performance correspondente a 20% (vinte por cento) da valorização das cotas do Fundo que exceder 100% (cem por cento) do Ibovespa. A taxa de performance será provisionada diariamente, por dia útil, apurada semestralmente por períodos vencidos e calculada individualmente em relação a cada Cotista.

O fundo é administrado pela Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 17.552, de 05 de dezembro de 2019, e gerido pela TRÍGONO CAPITAL LTDA. (CNPJ: 28.925.400/0001-27), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 16.129 de 05 de fevereiro de 2018.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90) credenciado como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 1.085 de 30 de agosto de 1989.

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em cotas do TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 130.397.014,76.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% por cotas de fundos de investimentos, sendo 100% do TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 29.177.013/0001-12) e 0,003% do DAYCOVAL TITULOS PUBLICOS I FIRF (CNPJ: 34.658.789/0001-94), que serão devidamente apresentados a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de julho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Conforme assembleia geral de cotistas realizada em 5 de julho de 2021, foi deliberado e aprovado a alteração da taxa de administração de 2,00% (dois por cento) ao ano para 2,50% (dois inteiros e cinquenta centésimos por cento) ao ano a consolidação do regulamento do Fundo a fim de prever a alteração supracitada, o qual terá vigência a partir de 9 de agosto de 2021.

Em Assembleia Geral Ordinária De Cotistas, realizada em 22 de novembro de 2021, deliberaram, por unanimidade e sem quaisquer ressalvas a aprovação das contas e demonstrações contábeis do Fundo referentes ao exercício social encerrado em 31 de julho de 2021.

- TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 29.177.013/0001-12)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso ou saída cobradas pelo fundo.

O Fundo possui taxa de performance correspondente a 20% (vinte por cento) da valorização das cotas do Fundo que exceder 100% (cem por cento) do o Índice Small Cap (SMLL). As datas base para efeito de aferição de prêmio a serem efetivamente pagos corresponderão ao último dia útil dos meses de junho e dezembro.

O fundo é administrado pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 8.695, de 20 de março de 2006, e gerido pela TRÍGONO CAPITAL LTDA. (CNPJ: 28.925.400/0001-27), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 16.129 de 05 de fevereiro de 2018.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o Banco BTG Pactual S.A. (CNPJ: 30.306.294/0001-45) credenciado como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo aplicar, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) em cotas do TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 210.359.276,08.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% cotas de fundos de investimentos, do TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 29.088.425/0001-86).

Em 06 de março de 2020, foi publicado Fato Relevante em que a Administradora informa que o fundo de investimento TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (“Fundo”) será fechado para captações a partir do fechamento do dia 06 de março de 2020.

Em 09 de abril de 2021, a Administradora publicou Fato Relevante comunicando que no fechamento do dia 09/04/21, os valores mínimos serão alterados conforme abaixo, de forma que será refletido na Lâmina do Fundo: (i) Valor Mínimo de Aplicação Inicial no FUNDO: R\$ 250,00; (ii) Valor Mínimo de Movimentações no FUNDO: R\$ 250,00; (iii) Valor Mínimo de Resgate no FUNDO: R\$ 250,00; e (iv) Valor Mínimo de Permanência no FUNDO: R\$ 100,00.

Em 22 de novembro de 2021, a Administradora publicou Fato Relevante comunicando que na abertura do dia 23/11/2021, os valores mínimos serão alterados conforme abaixo, de forma que será refletido na Lâmina do Fundo. - Valor Mínimo de Aplicação Inicial no FUNDO: R\$ 50,00 - Valor Mínimo de Movimentações no FUNDO: R\$ 50,00 - Valor Mínimo de Resgate no FUNDO: R\$ 50,00 - Saldo Mínimo de Manutenção no FUNDO: R\$ 30,00.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 3 de fevereiro de 2020 foi aprovada a cisão parcial do patrimônio do Fundo para o Trígono Flagship 60 Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento em Ações. A referida cisão parcial foi efetivada no fechamento do dia 5 de março de 2020, após o encerramento das operações do Fundo.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 22 de outubro de 2019 foi aprovada a alteração da política de investimento do Fundo. Tal alteração passou a fazer efeito no fechamento do dia 26 de novembro de 2019.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 18 de maio de 2021 foi aprovada a cisão parcial por passivo do patrimônio líquido do Fundo, com base no fechamento de 7 de junho de 2021, com versão da parcela cindida do seu patrimônio para o Trígono Flagship Small Caps 2 Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento em Ações.

- DAYCOVAL TITULOS PUBLICOS I FIRF (CNPJ: 34.658.789/0001-94)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Daycoval Asset Management Administração de Recursos LTDA. (CNPJ: 72.027.832/0001-02), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 8056 de 02 de dezembro de 2004. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90) credenciado como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 1.085 de 30 de agosto de 1989.

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 424.126.538,23.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Operações Compromissadas lastreadas em títulos públicos (59,11%) e Títulos Públicos Federais (40,98%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Primeiro Aditamento em 17 de outubro de 2019 - Alteração da razão social de Daycoval D44 Fundo de Investimento Multimercado Crédito Privado para Daycoval Guelt I Fundo de Investimento em Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Título Público, alteração de publico alvo, alteração de valores de taxa de administração, exclusão de taxa de performance, alteração de pagamento de resgate para D+0, alteração de exercício social, e aprovação de novo Regulamento.

Em Assembleia Geral realizada no dia 26 de novembro de 2019, houve a alteração da razão social a qual passa a ser Daycoval Títulos Públicos I Fundo de Investimento Renda Fixa, O Fundo passa a não ter horário máximo de envio de ordens para movimentação e resgate, consolidação do novo regulamento e definição de que o novo regulamento passará a vigorar a partir de 27 de novembro de 2019.

CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 08.070.841/0001-87)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BEM – Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA. (CNPJ: 00.066.670/0001-00), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552, de 07 de dezembro de 2019. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Banco Daycoval S.A.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.414.338.235,91.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% em cotas de fundo de investimentos, sendo 33,02% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 11.060.913/0001-10), 24,32% do CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), 14,66% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 (CNPJ: 03.737.217/0001-77), 13,52% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 30.068.240/0001-99), 5,26% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00), 4,38% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER HEDGE II MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 42.120.363/0001-00), 4,13% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 30.036.235/0001-02), 0,81% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALE DO RIO DOCE (CNPJ: 04.885.820/0001-69) e 0,14% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA ESG BDR NÍVEL I (CNPJ: 43.760.251/0001-87), onde serão apresentados adequadamente a seguir.

Foram localizados três Fatos Relevantes, publicados em 06 de dezembro de 2019 (referente ao Fechamento do Fundo para aplicações), 24 de março de 2020 (referindo-se à Reabertura do fundo para captação em 25/03/2020) e 03 de novembro de 2020 (referindo-se ao Fechamento para aplicações a partir da data da publicação).

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de janeiro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 03 de setembro de 2018 deliberou, a partir de 11 de outubro de 2018, a alteração do Regulamento do Fundo, no capítulo “Do Objetivo e da Política de Investimento”.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 25 de abril de 2019 deliberou, a partir do fechamento de 28 de maio de 2019, a substituição do Administrador do Fundo de BNY Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A para BEM – Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. e, a partir da abertura de 29 de maio de 2019, a alteração do Regulamento do Fundo, a fim de alterar o custodiante do Fundo de BNY Mellon Banco S.A para Banco Bradesco S.A, “Do Público Alvo, “Da Política de Investimento e Identificação dos Fatores de Risco”, “Da Remuneração e Demais Despesas do Fundo” e “Da Emissão e do Resgate de Cotas” e “Das Disposições Gerais”.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 11.060.913/0001-10)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 12.444.051.491,75.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (95,78%) e operações compromissadas (4,22%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LP (CNPJ: 05.164.353/0001-40)

Trata-se de um fundo constituído como condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

A administração e Gestão da carteira do Fundo é exercida pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), credenciada como Administradora e Gestora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. A custódia, tesouraria e controladoria dos ativos financeiros do Fundo também é realizada pela Caixa Econômica Federal, credenciada como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.231.328.576,72.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos federais (90,94%) e operações compromissadas em títulos públicos (8,61%), totalizando 99,55% do patrimônio líquido do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Conforme Assembleia Geral de Cotista realizada em 16 de novembro de 2020 foram deliberadas as seguintes alterações: I. Inclusão da classificação do Fundo, de acordo com o padrão utilizado pela Administradora. II. Alteração da política de investimento do Fundo, de forma a limitar a exposição da carteira do Fundo apenas ao risco de taxa de juros pós-fixadas. III. Artigo 6º: adequação no objetivo do fundo, com a exclusão da obrigatoriedade dos títulos públicos federais que compõem a carteira do Fundo sejam indexados a taxas de juros prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI); IV. Inclusão da previsão de que as deliberações da assembleia geral podem

ser adotadas mediante processo de consulta formal, sem necessidade de reunião de cotista, conforme artigo 71 da ICVM 555.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 (CNPJ: 03.737.217/0001-77)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.100.433.742,83.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (94,92%) e cotas de fundos de investimento (4,92%), sendo 2,82% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO (CNPJ: 30.036.209/0001-76), 1,3% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MASTER DIVIDENDOS QUANTITATIVO (CNPJ: 42.196.013/0001-28) e 0,76% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00), que representam o montante de 99,85% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 12 de janeiro de 2018, informando que no exercício de suas atividades e no intuito de defender eventuais direitos dos cotistas, o FUNDO aderiu ao procedimento arbitral, de cunho indenizatório, em face de Petróleo Brasileiro S.A – PETROBRAS, instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado - CAM B3.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 27 de dezembro de 2019, informando que no exercício de suas atividades e no intuito de defender eventuais direitos dos cotistas, o FUNDO

aderiu ao procedimento arbitral, de cunho indenizatório, em face da Vale S/A, instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado - CAM B3.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 08 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 30.068.240/0001-99)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 544.549.323,68.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (76,69%) e operações compromissadas (23,84%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Assembleia Geral de Cotista realizada em 15 de outubro de 2020, deliberou pela inclusão da classificação do Fundo, de acordo com o padrão utilizado pela Administradora; alteração da política de investimento do Fundo.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 27 de setembro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 13.694.392.169,03.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos (73,82%), operações compromissadas lastreadas em títulos públicos (26,10%), que representam o montante de 99,92% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Administradora deliberou pela alteração do regulamento do Fundo em 28 de julho de 2020, passando a não cobrar a Taxa de Administração do Fundo. A alteração foi realizada com base no

art. 47, inciso III da I CVM nº 555/2014 sem a necessidade de realização da Assembleia Geral de Cotistas e passou a vigorar em 30 de julho de 2020.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 27 de setembro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER HEDGE II MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 42.120.363/0001-00)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002,

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 151.800.333,81.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas (67,23%), títulos públicos federais (32,75%) e derivativos (0,01%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não foram encontradas informações a respeito do último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 30.036.235/0001-02)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.768.911.648,33.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas lastreadas em títulos públicos (51,93%) e títulos públicos (48,39%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

De acordo com a Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de dezembro de 2020, foram deliberadas as seguintes alterações: i. Alteração da razão social do Fundo de “Fundo de Investimento Caixa Bolsa Americana Multimercado Longo Prazo” para “Fundo de Investimento Caixa Indexa Bolsa Americana Multimercado Longo Prazo”; ii. Adequação do público alvo, de acordo com o padrão redacional utilizado pela Administradora e redução da taxa de administração que passa de 1,20% (um inteiro e vinte centésimos por cento) para 0,80% (oitenta centésimos por cento) ao ano sobre o valor do Patrimônio Líquido do Fundo.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALE DO RIO DOCE (CNPJ: 04.885.820/0001-69)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 915.813.167,22.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (99,37%) e cotas de fundos de investimento (0,31%), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DE LONGO PRAZO, que representam o montante de 99,68% do patrimônio do fundo.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 27 de dezembro de 2019, referente à Adesão do Fundo ao procedimento arbitral na CAM-B3, em face de Vale S/A.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA ESG BDR NÍVEL I (CNPJ: 43.760.251/0001-87)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

Ele é gerido pela CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A (CNPJ: 42.040.639/0001-40), devidamente autorizada e habilitada pela CVM para administrar carteira de ativos financeiros, incluindo fundos de investimento, a quem compete negociar, em nome do FUNDO, os ativos financeiros integrantes da carteira.

O fundo tem por objetivo buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MASTER ESG BDR NÍVEL I – CNPJ: 42.195.992/0001-08, que aplicará os seus recursos em ativos de renda variável negociados no Brasil, que atendam a critérios da temática ESG – Environmental, Social and Governance (Ambiental, Social e Governança) negociados no Brasil, não constituindo tal objetivo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 11.530.498,81.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% por cotas de fundo de investimento, 99,07% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MASTER ESG BDR NÍVEL I (CNPJ: 42.195.992/0001-08) e 1,01% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00).

Não há Fatos Relevantes publicados.

Não foi possível localizar informações acerca do parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 23 de novembro de 2021, foi deliberado sobre: (i) A transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e (ii) Aprovada a matéria acima, conseqüentemente, autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 (trinta) dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 254.548.889,84.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% em cotas de fundo de investimentos, sendo 97,65% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.060.913/0001-10) e 2,52% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), que serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.060.913/0001-10)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pela Caixa Econômica Federal, devidamente qualificada para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM nº 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice do Índice de Mercado ANBIMA - série B 5 - IMA-B 5.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 11.929.906.744,63.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (95,61%) e operações compromissadas em títulos públicos (4,39%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.256.533.826,03.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (88,81%) e operações compromissadas em títulos públicos (10,74%), representando 99,56% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 27 de setembro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP (CNPJ: 30.036.235/0001-02)

Trata-se de um fundo de investimentos constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, regido pelo presente Regulamento e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.768.911.648,33.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas lastradas em títulos públicos (51,93%) e títulos públicos (48,39%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

De acordo com a Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de dezembro de 2020, foram deliberadas as seguintes alterações: i. Alteração da razão social do Fundo de “Fundo de Investimento Caixa Bolsa Americana Multimercado Longo Prazo” para “Fundo de Investimento Caixa Indexa Bolsa Americana Multimercado Longo Prazo”; ii. Adequação do público alvo, de acordo com o padrão redacional utilizado pela Administradora e redução da taxa de administração que passa de 1,20% (um inteiro e vinte centésimos por cento) para 0,80% (oitenta centésimos por cento) ao ano sobre o valor do Patrimônio Líquido do Fundo.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP (CNPJ: 03.737.188/0001-43)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira será o Banco Bradesco S.A.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.426.442.696,60.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos (91,77%), operações compromissadas em títulos públicos (6,96%), ações (1,58%) e derivativos (0,08%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 12 de janeiro de 2018, informando que no exercício de suas atividades e no intuito de defender eventuais direitos dos cotistas, o FUNDO aderiu ao procedimento arbitral, de cunho indenizatório, em face de Petróleo Brasileiro S.A – PETROBRAS, instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado - CAM B3. A divulgação deste Fato Relevante segue os termos do Artigo 60 da Instrução CVM nº 555/14 e alterações posteriores.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 7 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO (CNPJ: 21.595.829/0001-54)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA (CNPJ: 06.947.853/0001-11), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 14.105, de 23 de fevereiro de 2015.

Ele é gerido pelo BANCO J. SAFRA S/A (CNPJ: 03.017.677/0001-20), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 11.124, de 24 de junho de 2010.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o BANCO SAFRA S/A (CNPJ: 58.160.789/0001-28), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Custódia de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.390, de 13 de junho de 2001.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em instrumentos representativos do Índice S&P 500 e em ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.394.295.587,10.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta 100% por Títulos Federais.

Não foi localizado Fato Relevante.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de fevereiro de 2019, foram aprovadas: (i) transferência da gestão do Fundo de Safra Asset Management Ltda., inscrita no CNPJ: 62.180.047/0001-31 para o Banco J. Safra S.A., inscrito no CNPJ: 03017.677/0001-20; e (ii) consolidação do texto do Regulamento para refletir as alterações deliberadas na Assembleia, o qual passará a vigorar a partir da data da transferência. As alterações entraram em vigor a partir de 15 de janeiro de 2019.

BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES (CNPJ: 28.578.936/0001-13)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou de performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM pelo Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar os recursos dos cotistas, no mínimo 67% e no máximo 100%, em ativos de renda variável, preponderantemente, em cotas de fundos de investimento no exterior.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.266.476.866,34.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por investimentos no exterior (98,79%) e operações compromissadas (0,18%), representando o montante de 98,97 do patrimônio total do fundo.

Foi localizado fato relevante, publicado em 18 de junho de 2021 informando o fechamento para novas aplicações do fundo BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IE FI, CNPJ: 28.578.936/0001-13 a partir do dia 25/06/2021, inclusive, e por prazo indeterminado.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO (CNPJ: 17.431.816/0001-72)

Trata-se de um fundo de investimentos constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, é regido pelo presente regulamento e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis.

O fundo é administrado e gerido pela BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM pelo Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar os recursos dos cotistas, preponderantemente, em ativos financeiros negociados no exterior, observadas as disposições contidas no art. 98 da Instrução CVM nº 555/14.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.524.236.266,09.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por investimentos no exterior (97,32%) e operação compromissada (0,74%), representando 98,07% do patrimônio total do fundo.

Foram localizados 2 fatos relevantes, publicados em 05 de novembro de 2019 e 10 de setembro de 2020 (referente à alteração dos valores de movimentação e permanência no Fundo).

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Não há informações sobre publicações disponíveis no site da CVM que comprovem a existência de reuniões ou assembleia de cotistas, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I (CNPJ: 21.470.644/0001-13)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou saída, cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 30.822.936/0001-69), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1481, de 13 de agosto de 1990.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é a Banco do Brasil S.A. (CNPJ: 00.000.000/0001-91), devidamente credenciado na CVM como custodiante, de acordo com o Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo buscar a valorização de suas cotas através da aplicação dos recursos em uma carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, que busque retorno superior à variação do CDI, através de investimentos em diversas classes de ativos financeiros, inclusive renda variável.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.396.743.051,17.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: Brazilian Depository Receipt – BDR (96,87%) operações compromissadas (1,85%) e fundos de investimentos (0,96%), do ISHARES S&P 500 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE ÍNDICE - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (CNPJ: 19.909.560/0001-91), que será apresentado adequadamente a seguir, que representam o montante de 99,68% do patrimônio do fundo.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 06 de novembro de 2020, informando que o percentual da taxa de administração do FUNDO será reduzido, de 1,00% (um inteiro por cento) ao ano, para 0,50% (cinquenta centésimos por cento) ao ano, a partir do dia 06/11/2020, inclusive.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em 06 de novembro de 2020, foi deliberado, por ato administrativo, alteração do Regulamento do Fundo: I) Alteração do Art. 9º reduzindo o percentual de taxa de administração para 0,50% (cinquenta centésimos por cento) ao ano. Tal deliberação entrou em vigor em 06 de novembro de 2020.

Em 04 de dezembro de 2020, foi deliberado, por Processo de Consulta Formal aos Cotistas, alteração do Regulamento do Fundo: I) Alteração do Nome do fundo para BB Ações ESG Fundo de Investimento em Ações – BDR Nível I; II) Alteração do objetivo do fundo para que atendam os critérios da tendência ESG (ambiental, social e governança corporativa). A vigência do novo Regulamento foi em 08 de dezembro de 2020.

- ISHARES S&P 500 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE ÍNDICE - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (CNPJ: 19.909.560/0001-91)

Trata-se de um m fundo de investimento em cotas de fundo de índice, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance, cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A (CNPJ: 01.522.368/0001-82), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 4.448, de 21 de agosto de 1997, e gerido pela BlackRock Brasil Gestora de Investimentos Ltda. (CNPJ: 10.979.208/0001-58), devidamente registrada para o exercício profissional de administração e gestão de carteiras de valores mobiliários, pelo Ato Declaratório CVM nº 10.568, de 4 de setembro de 2009.

O fundo tem por objetivo buscar retornos de investimentos que correspondam de forma geral à performance, antes de taxas e despesas, do Índice.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 5.120.150.011,34.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de março de 2021, é composta 100% por outros.

Foi localizado fato relevante, publicado em 05 de julho de 2018, informando que de acordo com o disposto no Artigo 3º, Parágrafo Terceiro da Instrução CVM nº 359, de 22 de janeiro de 2002, conforme alterada, (i) em razão do envio de 3 convocações para realização de Assembleia Geral de Cotistas do Fundo para deliberar sobre as aprovações das demonstrações financeiras referente ao exercício social encerrado em 31 de março de 2018, devidamente auditadas nos termos da legislação em vigor; e (ii) em razão da ausência de quórum suficiente em todas as Assembleias de Aprovação de Contas agendadas para 28 de Junho, 03 e 05 de Julho de 2018, consideram-se aprovadas as demonstrações contábeis do Fundo relativas ao exercício social encerrado em 31 de março de 2018.

Foi localizado fato relevante, publicado em 31 de agosto de 2018, convocando os cotistas para participar da Assembleia Geral de cotistas do FUNDO, que será realizada no dia 11 de setembro de 2018 na oportunidade serão discutidas e votadas a alteração do valor do Lote Mínimo de Cotas e a consolidação do regulamento do FUNDO.

Foi localizado fato relevante, publicado em 08 de julho de 2019, informando que a Assembleia Geral de Cotistas do Fundo, agendada para 28 de junho de 2019, não se realizou em razão do não comparecimento de quaisquer Cotistas. Nos termos do Artigo 30, Parágrafo 3º, da ICVM

359, tendo em vista que as demonstrações contábeis do Fundo cujo relatório de auditoria não conteve ressalvas e que após a primeira convocação de assembleia geral não houve quórum para deliberação relativa à matéria constante da Ordem do Dia, a referida matéria será considerada aprovada.

Foi localizado fato relevante, publicado em 30 de junho de 2020, informando que a partir de 01 de julho de 2020 a Taxa de Administração do FUNDO será reduzida, passando de 0,24% ao ano, para 0,23% ao ano, incidente sobre o Patrimônio Líquido, referente à remuneração global paga

mensalmente pelo Fundo, compreendendo também a taxa de administração paga ao Fundo de Índice Alvo, que será reduzida do equivalente a 0,04% ao ano para 0,03%, incidente sobre o patrimônio líquido do Fundo de Índice Alvo.

Foi localizado fato relevante, publicado em 11 de agosto de 2021, informando que a Assembleia Geral de Cotistas, que seria realizada excepcionalmente por meio eletrônico em 09 de agosto de 2021, a fim de deliberar sobre a aprovação das demonstrações financeiras auditadas do Fundo referentes ao exercício social encerrado em de 31 de março de 2021, não se realizou em razão do não comparecimento de Cotistas na conferência telefônica e do não recebimento de orientação de voto digitalizada por correio eletrônico. Assim, conforme faculta a legislação como as demonstrações financeiras acima mencionadas não contêm ressalvas e a assembleia não foi instalada, as supracitadas demonstrações foram consideradas automaticamente aprovadas.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

No dia 11 de setembro de 2018, foi realizada a Assembleia Geral de Cotistas do Fundo, sendo que na oportunidade foram aprovadas sem ressalvas as seguintes matérias: (i) a alteração do valor do Lote Mínimo de Cotas de 100.000 para 50.000 cotas nas “Definições”; e (ii) a consolidação do regulamento do Fundo, contemplando as alterações acima requeridas, a partir de 22 de outubro de 2018.

CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES (CNPJ: 17.502.937/0001-68)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras, negociados no Brasil, buscando uma rentabilidade diferenciada mediante alocação nesses ativos.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.890.658.229,39.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Brazilian Depositary Receipts (98,63%) e cotas do fundo de investimento (1,97%), do CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00), que será apresentado adequadamente a seguir. Quanto aos demais ativos, estão distribuídos em BDRs (98,93%), Investimentos no Exterior (0,16%) e Ações (0,05%), representando 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Conforme Assembleia Geral de Cotista realizada em 26 de outubro de 2020, foi deliberado pela aprovação da alteração do público-alvo do Fundo, com a exclusão de “pessoas físicas”, de modo a adequar o segmento prioritário estipulado, para participação no Fundo.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de renda fixa, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será a Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, tendo como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 13.694.392.169,03.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos (73,82%) e operações compromissadas lastreadas em títulos públicos (26,10%), representando 99,92% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de junho de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Administradora deliberou pela alteração do regulamento do Fundo em 28 de julho de 2020, passando a não cobrar a Taxa de Administração do Fundo. A alteração foi realizada com base no art. 47, inciso III da I CVM nº 555/2014 sem a necessidade de realização da Assembleia.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 27 de setembro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I (CNPJ: 19.436.818/0001-80)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de ações, constituído sob a forma de condomínio aberto e com prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA (CNPJ: 06.947.853/0001-11), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 14.105, de 23 de fevereiro de 2015.

Ele é gerido pelo BANCO J. SAFRA S/A (CNPJ: 03.017.677/0001-20), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 11.124, de 24 de junho de 2010.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira é o BANCO SAFRA S/A (CNPJ: 58.160.789/0001-28), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Custódia de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.390, de 13 de junho de 2001.

O fundo tem por objetivo é atuar no sentido de propiciar aos seus condôminos valorização de suas cotas mediante a aplicação de seus recursos, preponderantemente, em ativos de renda variável, notadamente em certificados de depósitos de valores mobiliários BDRs Nível 1, do setor de consumo.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.983.843.860,12.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por Brazilian Depositary Receipts (70,16%), Títulos Federais (23,39%), operação compromissada (7,41%), representando o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não foi localizado Fato Relevante.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de dezembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 06 de setembro de 2018, foi aprovada a mudança da política de investimentos do Fundo a fim de adequá-los aos limites e vedações da Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 3.922/10 que dispõe sobre os investimentos de recursos administrados por Regimes Próprios de Previdência. A alteração entrou em vigor a partir de 01 de novembro de 2018.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de fevereiro de 2019, foram aprovadas: (i) a transferência da gestão do Fundo da Safra Asset Management Ltda., inscrita no CNPJ: 62.180.047/0001-31 para o Banco J. Safra S.A., inscrito no CNPJ: 03.017.677/0001-20; e (ii) a consolidação do texto do Regulamento para refletir as alterações deliberadas na Assembleia, o

qual passará a vigorar a partir da data da transferência. As alterações entraram em vigor a partir de 15 de fevereiro de 2019.

Em Instrumento Particular de Alteração de Fundo de Investimento datado em 17 de maio de 2019 foi aprovado a alteração no regulamento do prazo de liquidação e pagamento de resgates, os quais serão antecipados em um dia, mantendo-se inalteradas as demais condições. A alteração entrou em vigor a partir de 27 de maio de 2019.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 09 de setembro de 2019, foram aprovadas: (i) a mudança da política de investimento a fim de adequá-lo aos limites e vedações da Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 4.661/18, que dispõe sobre as diretrizes de aplicação dos recursos garantidores dos planos administrados pelas Entidades Fechadas de Previdência Complementar; (ii) a alteração da composição carteira do Fundo, para adequação à nova política; e (iii) as demais alterações deliberadas na Assembleia. As alterações entraram em vigor a partir de 14 de outubro de 2019.

Em Assembleia Geral de Cotistas realizada em 29 de junho de 2020, foram aprovadas: (i) a mudança da política de investimento a fim de adequá-lo aos limites e vedações da Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 4.444/15, que dispõe sobre as diretrizes de aplicação dos recursos garantidores dos planos administrados pelas Entidades Fechadas de Previdência Complementar; (ii) a alteração da composição da carteira do Fundo, para adequação à nova política; e (iii) as demais alterações deliberadas na Assembleia. As alterações entraram em vigor a partir de 13 de agosto de 2020.

CONCLUSÃO

Da análise apresentada, não havendo fundos de investimentos que apresentem classificação de estruturados ou operações com títulos e/ou papéis em operações estruturados, concluímos que o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA, não somente contemplando a emissão desse relatório venha adquirir a habitualidade de acompanhar com proximidade todas as instituições financeiras que hoje compõe a sua carteira de investimentos.

O acompanhamento diligente dos gestores do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA na atuação das Instituições Financeiras através da participação ativa de convocações de reuniões e assembleias de cotistas, minimiza ações de infortúnios futuros.

Orientamos também, em complemento, que o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA venha adotar regras, procedimentos e controles internos que integrem nos fluxos e manuais todos os processos relacionados a gestão dos recursos, incluindo este relatório.

Caso haja a necessidade da aplicação do Plano de Contingência frente ao descasamento evidenciado, recomenda-se seguir os parâmetros traçados na Política de Investimentos Anual, tendo o Comitê de Investimentos a responsabilidade pelo chamamento, apuração e julgamento do processo de execução do Plano.

Orientamos complementarmente que, além da Política de Investimentos apresentar o Plano de Contingência, o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA venha buscar sua inclusão no Regimento Interno do Comitê de Investimentos, a fim de trazer com clareza sua atuação no atendimento e resolução da pauta.

Aproveitamos para ressaltar, em se tratando do cenário atual, orienta-se que a diversificação mesmo em títulos públicos, proporciona a busca por maiores prêmios no curto prazo ou ainda na conservação da posição atual da carteira de investimentos, não comprometendo a liquidez da carteira de investimentos em honrar seus compromissos.

Ainda se tratando do risco de mercado, orienta-se cautela e acompanhamento a respeito da sugestão, buscando a melhor saída para o retorno das aplicações, em um contexto favorável ao desinvestimento.

A carteira de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA se mostra diversificada em um grau moderado, sendo a diversificação uma técnica que permite reduzir os riscos através da alocação em fundos de investimentos de vários vértices e ativos, principalmente os de crédito, tornando-se uma importante ferramenta para maximizar o retorno correndo menos riscos.

Embora não seja o suficiente para garantir a não ocorrência de perdas, investir em ativos variados que reagem de forma diferente ao mesmo evento certamente pode reduzir de forma significativa o risco ao investir.

Alertamos que, tomar decisões precipitadas enseja realizar uma perda decorrente da desvalorização dos investimentos sem possibilidades de recuperar na retomada do mercado. Para aqueles que enxergam, que estamos diante de uma excelente oportunidade para investir

recursos de longo prazo a preços mais baratos, municie-se das informações necessárias para subsidiar a tomada da decisão e siga em frente.

Assim como a diversificação dos ativos que compõe a carteira de investimentos é de suma importância, é também a compreensão da necessidade da diversificação dos prestadores de serviços ligados aos fundos de investimentos, as instituições financeiras (as que exercem a função de Administração, Gestão e Custódia dos fundos de investimentos).

Este tipo de diversificação minimiza os riscos dos ativos quanto a possíveis imprudências de gestão e/ou administração.

Com a conquista da Certificação Institucional Pró-Gestão Nível I, o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA tem a possibilidade de aumentar sua exposição em vários subsegmentos permitidos pela Resolução CMN nº 3.922/2010 e, diante dessa possibilidade, sugerimos a busca pelas melhores oportunidades dentro do cenário atual.

Quando pela busca de aumentar a duração ou *duration* da carteira de investimentos através de fundos de investimentos ilíquidos ou estruturados, em consequência do casamento do ativo e passivo, orientamos que no momento do seu credenciamento e análise, o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA providencie o atestado de compatibilidade com suas obrigações presentes e futuras em cumprimento ao Art. 3º, parágrafo 4º da Portaria nº 519/2011.

Complementarmente, sugerimos que o INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA preserve a informação obtida no ALM, dispondo de relatórios de acompanhamento da implantação das estratégias propostas e deliberadas, bem como na elaboração de diagnósticos, com propostas de revisão de alocação das aplicações financeiras sempre que for necessário.

A emissão de um relatório de viabilidade fiscal, financeiro e orçamentário também fica como sugestão de ferramenta na gestão dos ativos e passivos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA, no que diz respeito a solvabilidade do Plano de Custeio implementado. Este deve ter como participante ativo o Ente Federativo, pois é o principal patrocinador do Plano de Custeio.

Esse relatório atende ao décimo segundo mês do exercício de 2021.

Permanecemos à disposição para eventuais esclarecimentos.

Atenciosamente,



Renan Foglia Calamia

Pós-Graduação em *Advanced Program in Finance*
CEA e CGA Anbima / Economista
Consultor de Valores Mobiliários



Nahida Zahra Lakis

Bacharelado em Direito
CPA-10 Anbima
Analista de Compliance

CRÉDITO E MERCADO – CONSULTORIA EM INVESTIMENTOS
(C.N.P.J.: 11.340.009/0001-68)

DISCLAIMER

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Esta é apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis. A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade das mesmas, e não devem ser consideradas como tais. As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos e prospectos de divulgação. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, ao risco e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários). Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM. A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.