



RELATÓRIO DE DILIGÊNCIA E ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES
PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE CARIACICA - IPC**

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.....	11
Liquidez	14
ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	15
Instituições Financeiras.....	15
Análise da Situação das Instituições Financeiras	15
ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS.....	16
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 09.594.596/0001-70)	16
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA (CNPJ: 21.005.667/0001-57).....	18
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.111.384/0001-69).....	20
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.303.793/0001-46).....	21
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.303.795/0001-35).....	22
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.523.305/0001-06)	24
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 18.598.288/0001-03)	25
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 20.139.595/0001-78).....	26
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 19.769.046/0001-06)	27
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 23.215.097/0001-55)	28
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
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 14.508.605/0001-00)	32
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP (CNPJ: 10.646.895/0001-90).....	33
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 30.378.445/0001-70).....	35
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO (CNPJ: 00.838.267/0001-52)	41
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26)	43
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.588/0001-89)	45
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP (CNPJ: 13.077.418/0001-49)	46
BB IPCA III RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO (CNPJ: 14.091.645/0001-91)	48

BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 08.018.849/0001-02)	51
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES (CNPJ: 35.998.413/0001-91)	54
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES (CNPJ: 18.270.783/0001-99)	58
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 07.882.792/0001-14)	60
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 30.068.169/0001-44)	62
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES (CNPJ: 15.154.441/0001-15)	65
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES (CNPJ: 14.507.699/0001-95)	67
OCCAM FIC AÇÕES (CNPJ: 11.628.883/0001-03)	69
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18)	71
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP (CNPJ: 30.036.235/0001-02)	74
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 (CNPJ: 17.098.794/0001-70)	75
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES (CNPJ: 28.578.936/0001-13)	77
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.331.342/0001-02)	78
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.331.365/0001-09)	79
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.308.394/0001-50)	80
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES (CNPJ: 17.502.937/0001-68)	83
CONCLUSÃO	84
DISCLAIMER	86

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 – julho/2021

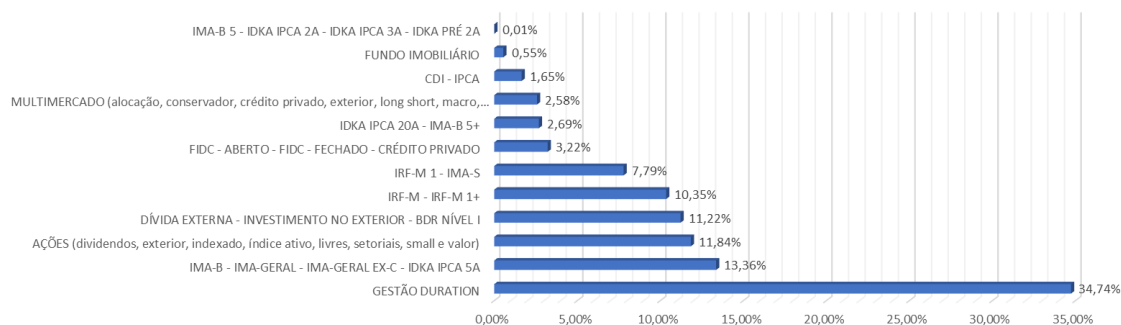
Produto / Fundo	Benchmark	Disponibilidade	Carência	Saldo	Carteira %
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	D+0	Não há	12.699.200,04	3,74%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	D+1	Não há	19.231.538,75	5,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IRF-M	D+1	Não há	15.633.709,35	4,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	D+0	15/08/2022	5.131.313,61	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	D+0	15/08/2024	7.055.158,55	2,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	D+0	15/08/2022	546.807,58	0,16%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	D+0	16/08/2024	8.586.545,00	2,53%
CAIXA BRASIL 2030 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	D+0	15/08/2024	9.691.250,00	2,85%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B 5+	D+0	15/08/2030	9.133.355,00	2,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+0	Não há	48.134.966,98	14,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B 5	D+0	Não há	25.527,08	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	D+0	Não há	7.220.512,40	2,13%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IRF-M	D+0	Não há	19.525.940,80	5,75%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	IMA-B	D+0	Não há	1.668.024,01	0,49%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+2	Não há	19.311.975,08	5,69%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	D+0	Não há	939.577,99	0,28%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	CDI	D+0	Não há	1.951.792,08	0,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	GESTÃO DURATION	D+3	Não há	50.521.382,03	14,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	CDI	D+0	Não há	2.719.949,57	0,80%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	10.937.859,16	3,22%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+34	Não há	16.328.339,06	4,81%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	AÇÕES - DIVIDENDOS	D+5 du	Não há	1.982.925,31	0,58%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+4	Não há	8.200.290,28	2,41%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+3	Não há	3.031.630,14	0,89%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+15	Não há	3.797.573,42	1,12%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	AÇÕES - DIVIDENDOS	D+33	Não há	1.695.640,60	0,50%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+23	Não há	3.075.728,36	0,91%
OCCAM FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+4 ou D+18	Não há	2.103.846,63	0,62%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - MODERADO	D+15	Não há	8.750.785,15	2,58%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - EXTERIOR	D+1	Não há	8.549.749,90	2,52%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	FUNDO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica	1.856.250,00	0,55%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXT	AÇÕES - EXTERIOR	D+5 du	Não há	5.744.759,29	1,69%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	AÇÕES - EXTERIOR	D+6 du	Não há	1.773.936,78	0,52%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	AÇÕES - EXTERIOR	D+6 du	Não há	2.634.809,55	0,78%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERI	AÇÕES - EXTERIOR	D+4 du	Não há	1.020.574,53	0,30%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	AÇÕES - EXTERIOR	D+4	Não há	18.381.408,72	5,41%
				339.594.632,78	

Fonte: Sistema Crédito e de Mercado posição julho de 2021

Distribuição Estratégica – julho/2021

Sub-Segmento	Posição R\$	%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	0,00%
GESTÃO DURATION	117.968.324,09	34,74%
IDKA IPCA 20A - IMA-B 5+	9.133.355,00	2,69%
IMA-B - IMA-GERAL - IMA-GERAL EX-C - IDKA IPCA 5A	45.378.298,79	13,36%
IRF-M - IRF-M 1+	35.159.650,15	10,35%
IMA-B 5 - IDKA IPCA 2A - IDKA IPCA 3A - IDKA PRÉ 2A	25.527,08	0,01%
IRF-M 1 - IMA-5	26.452.051,15	7,79%
CDI - IPCA	5.611.319,64	1,65%
POUPANÇA - OP COMPROMISSADAS - CDB - CVS - DISPONIBILIDADE	0,00	0,00%
FIDC - ABERTO - FIDC - FECHADO - CRÉDITO PRIVADO	10.937.859,16	3,22%
AÇÕES (dividendos, exterior, indexado, índice ativo, livres, setoriais, small e valor)	40.215.973,80	11,84%
MULTIMERCADO (alocação, conservador, crédito privado, exterior, long short, macro, moderado e outros)	8.750.785,15	2,58%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.856.250,00	0,55%
FIP	0,00	0,00%
DÍVIDA EXTERNA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR - BDR NÍVEL I	38.105.238,77	11,22%
	339.594.632,78	100,00%

Distribuição em %



A carteira de investimentos do IPC está segregada entre os segmentos de renda fixa, renda variável e investimentos no exterior, sendo 73,81%, 14,97% e 11,22%, não ultrapassando o limite de 45% permitido pela Resolução CMN nº 3.922/2010 para o segmento de renda variável para os RPPS que já possuem a Certificação Institucional Pró-Gestão Nível III.

O IPC conquistou a Certificação Pró-Gestão Nível III em 16 de maio de 2019.

Retratando uma gestão arrojada, a carteira de investimentos do IPC apresenta uma considerável diversificação, que se dispõe na exposição em fundos de investimentos compostos por 100% em títulos públicos, atrelados em vértices de curto, médio, longo e longuíssimo prazo. Ainda se tratando de renda fixa, a maior exposição está em fundos de investimentos classificados como de *gestão duration*, seguidos de fundos de investimentos compostos por 100% em títulos públicos, atrelados aos vértices de longo prazo. Apresenta ainda uma singela exposição em fundos de investimentos de crédito privado.

No âmbito da renda variável, a carteira de investimentos do IPC se apresenta diversificada em fundos de investimentos em ações e multimercado.

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

- **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;
- **DIVIDENDOS:** investem em ações de empresas com histórico de *dividend yield* (renda gerada por dividendos) consistente ou que, na visão do gestor, apresentem essas perspectivas.
- **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) e

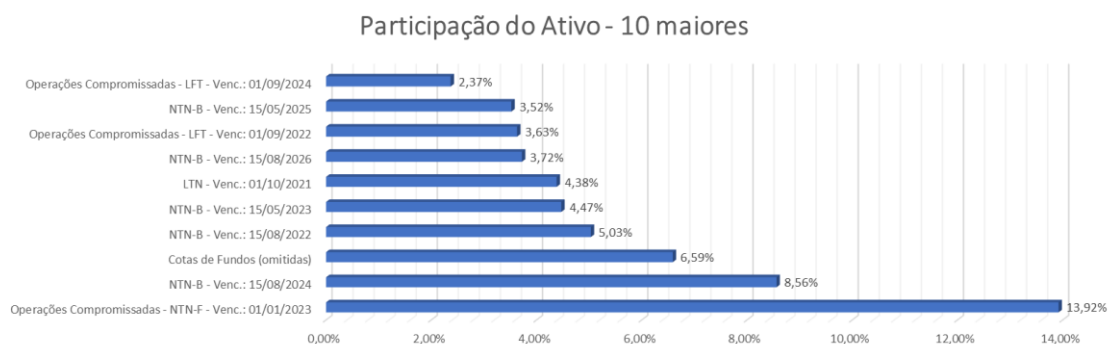
- **EXTERIOR:** fundos de investimentos que investem em ativos financeiros no exterior em parcela superior a 40% do patrimônio líquido. Estes fundos seguem o disposto no art. 101 da Instrução nº 555 da CVM. No âmbito dos fundos de investimentos classificados como Multimercado, o hedge cambial da parcela 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:

- **LIVRE OU MODERADO:** não tem o compromisso de concentração em alguma estratégia específica.

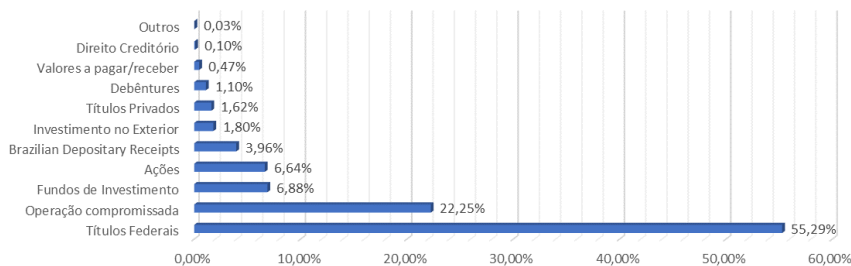
Para finalizar, a carteira de investimentos do IPC apresenta uma singela exposição em fundos de investimentos classificados como imobiliário.

Distribuição Consolidada da Carteira – julho/2021



Ao analisarmos as dez maiores participações na carteira de investimentos do IPC, identificamos uma pequena exposição em cotas de fundos de investimentos classificados como “Omitidas”, pois o administrador fez valer do Art. 56, parágrafo 3º, inciso II da Instrução CVM nº 555/2014. Ainda assim, quanto aos demais ativos, pode-se identificar a alta concentração em títulos públicos e operações compromissadas atreladas em títulos públicos.

Tipo de Aplicação



A distribuição consolidada da carteira de investimento do IPC 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 77,55% do total do patrimônio. Há também participação em fundos de investimentos, ações, *Brazilian Depositary Receipts*, Investimentos no Exterior, Títulos Privados e Debêntures que representam o somatório de 22,00% do total do patrimônio, além de outros demais ativos com baixa representatividade, que representam 0,60%.

Casamento de Ativo e Passivo

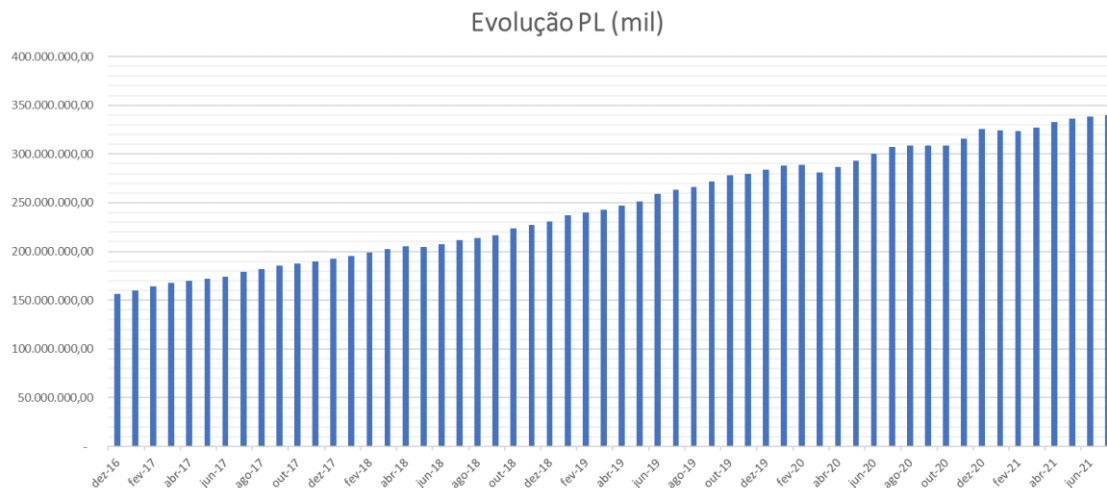
O estudo de casamento de ativo e passivo tem por objetivo identificar a razão de solvabilidade do plano de benefícios do RPPS, considerando premissas e hipóteses de simulação com base em fluxos de caixa atuarial e cenários macroeconômicos, e proporá composições de carteiras de investimentos que possam suportar e alongar a sobrevivência do plano de benefícios, 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, podemos considerar que o fluxo de caixa previdenciário para os próximos 10 (anos) anos é positivo, ou seja, o IPC 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.

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 reproduzir eficiência, 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 IPC.

Evolução Patrimonial

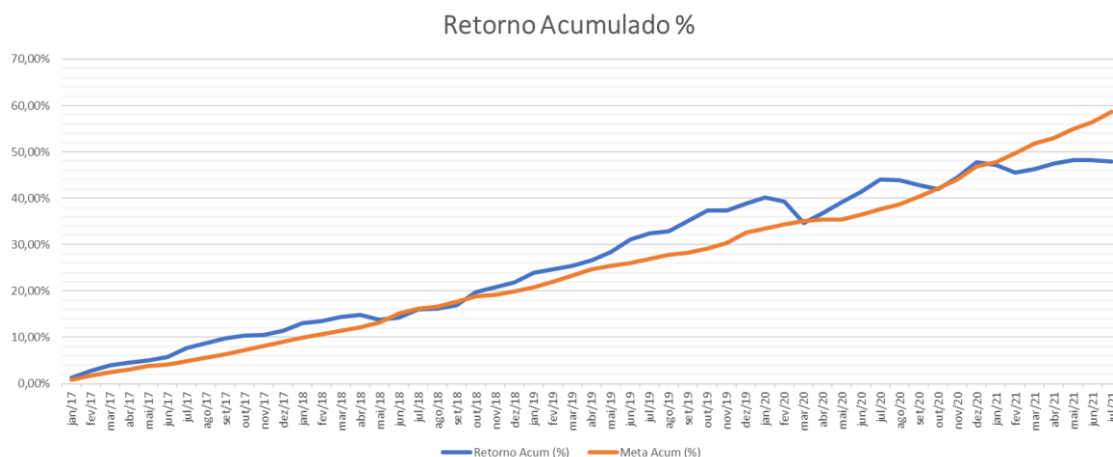


Destaca-se um crescimento contínuo e de boa curvatura evolutiva, não havendo períodos de retração ou declínio contínuo, havendo uma diminuição do patrimônio líquido ainda no primeiro trimestre de 2020, resultado esse devido ao péssimo desempenho do mercado financeiro.

Ao final do mesmo período, observamos uma retomada no crescimento do patrimônio líquido, igualitário ou superior aos resultados apresentados antes ao declínio. É possível notar que o patrimônio líquido do IPC vem seguindo uma curvatura crescente e notória, acumulando mais recursos mês a mês.

Chamamos a atenção quanto a possibilidade de haver novos períodos de retração ou declínio no patrimônio líquido do IPC, 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 e certa, as retrações poderão ser discretas ou quase imperceptíveis, apresentando posteriormente uma recuperação gradativa.

Rentabilidade



O retorno acumulado no período demonstrado no gráfico não supera sua meta de rentabilidade no longo prazo, devido aos atuais acontecimentos mercadológicos, podendo haver novos e maiores declínios, contudo, há grande possibilidade de retomada e conseqüentemente, novamente, voltar a superar a meta atuarial no longo prazo.

O não atingimento da meta de rentabilidade, representa 58,63% de meta de rentabilidade estabelecida contra 47,87% de rentabilidade obtida pela carteira de investimentos.

Rentabilidade da Carteira de Investimentos

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO	ACUM
2017	Carteira	1,21%	1,59%	1,12%	0,57%	0,39%	0,72%	1,80%	0,96%	1,04%	0,58%	0,12%	0,73%	11,37%	11,37%
	Meta	0,89%	0,75%	0,78%	0,56%	0,82%	0,26%	0,73%	0,72%	0,62%	0,91%	0,74%	0,91%	9,04%	9,04%
2018	Carteira	1,49%	0,37%	0,89%	0,29%	-0,81%	0,29%	1,57%	0,22%	0,57%	2,46%	0,84%	0,85%	9,37%	21,81%
	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%	19,84%
2019	Carteira	1,78%	0,53%	0,65%	0,97%	1,41%	2,01%	1,08%	0,36%	1,63%	1,69%	0,02%	1,06%	13,99%	38,85%
	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%	32,53%
2020	Carteira	1,00%	-0,70%	-3,33%	1,63%	1,64%	1,62%	1,91%	-0,10%	-0,70%	-0,59%	1,72%	2,26%	6,39%	47,73%
	Meta	0,72%	0,67%	0,58%	0,15%	0,08%	0,75%	0,90%	0,73%	1,13%	1,35%	1,36%	1,87%	10,77%	46,81%
2021	Carteira	-0,39%	-1,13%	0,51%	0,86%	0,47%	0,07%	-0,28%						0,10%	47,87%
	Meta	0,68%	1,25%	1,43%	0,74%	1,28%	0,98%	1,43%						8,05%	58,63%

*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 IPC obteve no mês de referência o resultado de -0,28%, diminuindo o resultado acumulado para o mesmo exercício, equivalente a 0,10%. A meta de rentabilidade, por sua vez, fechou o mês de referência com o resultado de 1,43%, acumulando para o mesmo exercício o montante de 8,05%.

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 consequentemente, 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 IPC para controle do risco de mercado.

Análise de Risco– carteira de julho/2021

	Retorno	VaR (95% MV 21 du)	Julho de 2021		
			Renda Fixa	Renda Variável	Invst. Exterior
Carteira de Investimentos	-0,28%	2,92%	1,24%	7,18%	8,54%

Produto / Fundo	Julho de 2021		
	Retorno	Volatilidade	VaR (95% MV 21 du)
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	7,87%	17,60%	8,36%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,73%	16,61%	7,88%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,34%	16,42%	7,80%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	16,84%	7,99%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,63%	11,92%	5,66%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1,80%	28,31%	13,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	0,88%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	0,88%	0,42%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	0,18%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	1,34%	0,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,39%	0,03%	0,01%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,17%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,48%	0,23%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,07%	0,79%	0,37%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,03%	1,91%	0,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	2,11%	1,00%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,07%	2,34%	1,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,11%	2,31%	1,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,18%	2,69%	1,28%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,18%	2,69%	1,28%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,39%	4,32%	2,05%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,46%	3,07%	1,46%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47%	2,69%	1,28%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,50%	2,69%	1,28%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,59%	5,42%	2,58%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,72%	5,74%	2,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,78%	3,53%	1,68%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,78%	17,44%	8,28%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,17%	17,08%	8,11%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-3,75%	15,85%	7,53%
OCCAM FIC AÇÕES	-4,12%	19,83%	9,41%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,27%	18,82%	8,94%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-4,41%	17,96%	8,53%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,56%	18,92%	8,98%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,66%	16,21%	7,70%

*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 IPC são reflexo das oscilações do mercado, mantendo-se a alta volatilidade do mercado 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, proporcionando 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

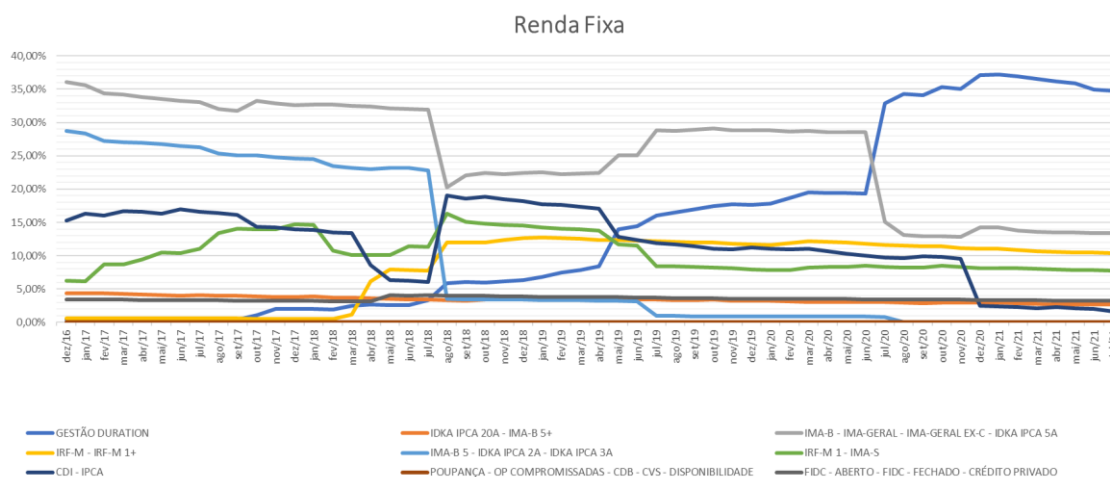
Histórico de Movimentações para o Exercício de 2021

Fundos de Investimentos	dez-20	jan-21	fev-21	mar-21	abr-21	mai-21	jun-21	jul-21
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.304.111,62	12.973.971,86	12.654.364,28	12.460.871,72	12.554.771,52	12.697.542,44	12.791.263,79	12.699.200,04
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.935.137,50	9.919.056,25	9.540.493,75	9.547.250,00	9.689.137,50	9.740.625,00	9.708.993,75	9.691.250,00
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BANESTES REFERENCIAL IRF-M I FI RENDA FIXA	19.326.307,73	19.101.518,25	19.159.738,58	19.110.286,08	19.183.855,72	19.202.599,29	19.217.509,13	19.231.538,75
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	546.032,43	547.598,43	533.083,48	535.170,21	537.337,57	541.350,95	543.245,45	546.807,58
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.804.470,00	8.790.180,00	8.453.195,00	8.459.135,00	8.584.800,00	8.630.375,00	8.602.305,00	8.586.545,00
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.983.821,31	15.856.147,66	15.667.367,31	15.533.633,25	15.660.070,53	15.684.958,15	15.712.070,64	15.633.709,35
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.158.728,01	7.160.533,44	7.161.826,55	7.162.484,06	7.182.713,56	7.194.940,58	7.208.512,77	7.220.512,40
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.232,24	25.253,24	25.096,74	25.174,91	25.391,83	25.561,80	25.523,53	25.527,08
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.690.695,00	9.552.480,00	9.114.555,00	9.005.125,00	9.050.320,00	9.121.365,00	9.187.465,00	9.133.355,00
BB IMA-B 5 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.553.249,76	4.146.548,85	3.731.265,21	3.302.718,63	2.863.898,63	2.407.014,65	1.942.080,78	1.951.792,08
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.117.658,37	5.132.579,53	5.000.995,73	5.020.843,12	5.041.359,25	5.079.153,66	5.097.579,35	5.131.313,61
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.103.634,03	7.114.232,64	6.898.113,25	6.918.446,06	6.969.219,32	7.016.793,98	7.026.920,72	7.055.158,55
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB PERFIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.148.071,87	3.153.270,51	3.156.276,52	3.163.861,97	3.170.172,56	3.179.179,73	3.189.635,98	3.219.949,57
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.874.354,51	10.885.001,33	10.768.252,77	10.790.384,22	10.895.486,58	10.953.201,31	10.945.575,98	10.937.859,16
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FI AÇÕES	1.687.282,42	1.623.796,13	1.553.764,67	1.641.049,38	1.682.418,74	1.782.453,79	1.751.136,40	1.695.640,60
BB PIPE FI AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	8.025.796,41	7.733.561,12	7.507.232,15	7.826.050,41	8.139.010,32	8.496.200,05	8.578.788,31	8.200.290,28
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	16.091.217,68	17.022.424,67	17.626.145,77	18.230.329,78	18.341.960,58	0,00	0,00	0,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.421.250,00	2.852.750,00	2.450.000,00	2.487.250,00	2.375.000,00	2.290.000,00	2.094.250,00	1.856.250,00
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.688.432,22	1.673.541,55	1.647.582,76	1.639.502,83	1.649.772,17	1.667.297,35	1.674.475,93	1.668.024,01
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	15.173.151,02	15.079.982,88	14.699.909,97	14.981.071,59	15.669.438,87	16.236.927,76	16.445.431,37	16.328.339,06
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.954.323,83	19.800.452,97	19.572.133,41	19.398.453,63	19.549.087,93	19.582.232,74	19.617.927,80	19.525.940,80
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	282.774,58	596.397,92	512.039,50	571.949,38	1.453.247,81	1.570.734,43	1.669.386,51	939.577,99
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	19.444.688,97	19.284.512,65	19.120.533,63	19.026.696,37	19.139.115,21	19.241.433,73	19.305.848,77	19.311.975,08
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA VALOR RPPS FI AÇÕES	3.042.535,01	2.946.986,98	2.817.646,78	2.960.919,34	3.035.347,67	3.228.353,57	3.212.982,47	3.075.728,36
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	7.951.000,17	7.969.604,26	7.936.767,69	8.062.278,57	8.791.246,64	8.791.623,41	8.750.785,15	8.750.785,15
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	50.777.234,20	50.540.529,02	50.071.351,59	49.898.691,73	50.251.740,54	50.553.937,25	50.577.610,33	50.521.382,03
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	50.633.575,90	50.663.942,96	50.406.801,95	50.558.551,30	50.894.527,08	51.016.006,84	48.511.230,12	48.134.966,98
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.322.526,66	2.207.123,18	2.100.170,34	2.283.437,37	2.341.308,63	2.477.275,88	3.118.368,45	3.031.630,14
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.002.490,47	1.931.022,54	1.851.529,58	2.001.780,44	2.003.115,09	2.061.269,99	2.060.257,35	1.982.925,31
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.343.969,58	3.342.194,98	4.891.462,46	5.864.319,59	6.743.440,05	7.445.581,81	8.330.793,62	8.549.749,90
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2.333.304,38	2.474.571,12	3.544.502,46	4.457.053,52	5.017.355,29	5.543.964,59	5.325.454,70	5.744.759,29
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.036.162,91	1.078.788,83	1.661.422,77	1.734.679,54	1.753.268,29	1.696.693,10	1.662.149,10	1.773.936,78
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.038.129,77	1.106.902,37	1.899.518,39	2.545.553,66	2.565.106,21	2.388.095,07	2.588.177,81	2.634.809,55
OCCAM FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.352.529,99	1.346.036,62	2.103.846,63
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	17.646.013,93	17.436.296,17	18.381.408,72
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3.118.183,54	3.797.573,42
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.020.574,53
	325.821.350,56	324.287.458,12	323.735.140,04	327.205.002,66	332.685.078,87	336.542.910,05	338.415.090,65	339.594.632,78

Movimentações de julho/2021

Produto / Fundo	Benchmark	Data de Movimentação	Movimento R\$	Benchmark	Movimento R\$ Final
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	AÇÕES - EXTERIOR	14/07/2021	1.000.000,00	AÇÕES - EXTERIOR	1.000.000,00
OCCAM FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	08/07/2021	841.041,88	AÇÕES - VALOR	841.041,88
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	FUNDO IMOBILIÁRIO	12/07/2021	-8.982,50	FUNDO IMOBILIÁRIO	-8.982,50
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	08/07/2021	841.041,88	AÇÕES - LIVRES	1.519.101,53
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	15/07/2021	8.982,50	CDI	-1.214.844,67
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	CDI	28/07/2021	-482.046,46		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	01/07/2021	-176,00		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	06/07/2021	-46.816,63		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	08/07/2021	-3.405,97		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	12/07/2021	-7.063,19		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	15/07/2021	-264.031,96		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	19/07/2021	10.046,41		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	20/07/2021	9.452,43		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	21/07/2021	2.118,08		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	26/07/2021	25.271,68		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	27/07/2021	3.470.341,01		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	28/07/2021	152.793,82		
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	CDI	29/07/2021	-4.081.327,89		
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	08/07/2021	669.077,15		

Histórico de Movimentações Acumuladas

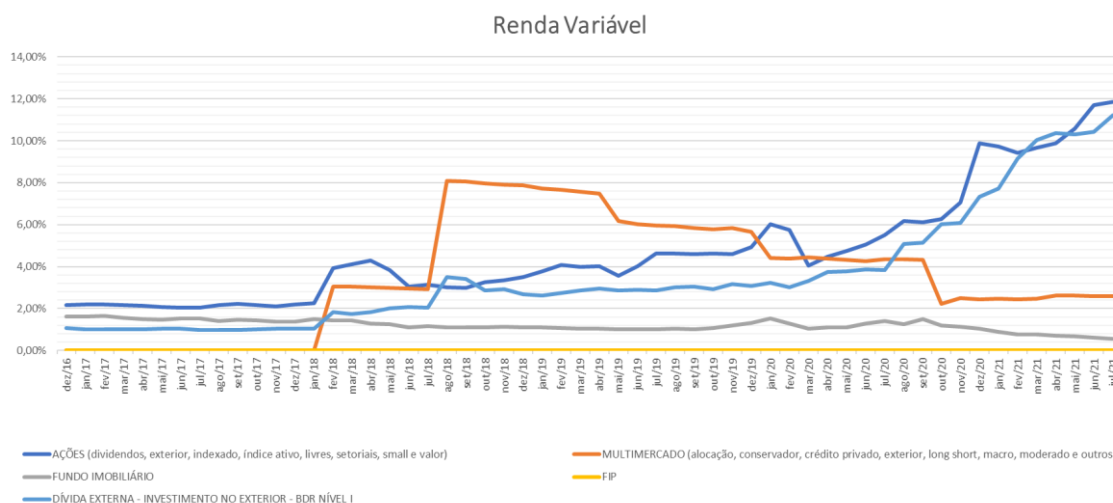


A exposição em renda fixa sai de uma elevada concentração em fundos de investimentos compostos por títulos públicos, atrelados a vértices de curto, médio, longo e longuíssimo prazo, trazendo essa exposição para o exercício de 2017 completo.

No segundo semestre de 2018, houve uma redução drástica na posição em fundos de investimentos atrelados aos vértices já citados, sendo realocados em fundos de investimentos atrelados a vértices de curto prazo e referenciados ao CDI.

Podemos ainda destacar a exposição em fundos de investimentos classificados como gestão *duration* que vem alçando no decorrer dos dois últimos exercícios, uma posição significativa no patrimônio líquido do IPC.

No exercício de 2021, ainda no primeiro semestre, as movimentações foram discretas, não havendo grandes realocações.



A introdução de renda variável na carteira de investimentos do IPC iniciou-se no nosso banco de dados, contemplando fundos de investimentos classificados como de ações, imobiliário e investimentos no exterior.

No primeiro trimestre de 2018, houve a busca por oportunidades em fundos de investimentos multimercado, aumentando sua exposição no início do segundo trimestre do mesmo exercício, o que não perdurou no exercício de 2020.

Os demais investimentos demonstrados no gráfico acompanharam o aumento de exposição ora mencionado, de modo que em dezembro de 2019 o IPC possuía cotas de fundos de investimentos em ações e multimercado no mesmo grau de exposição.

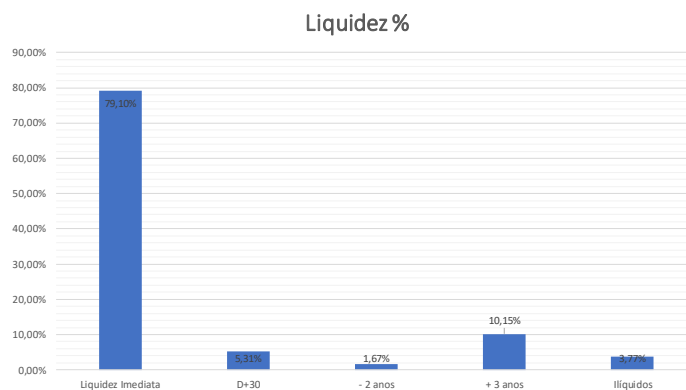
No exercício de 2020, o IPC buscou aumentar sua exposição em renda variável através de novos investimentos em fundos de investimentos em ações e investimentos no exterior.

Posteriormente, em 2021, houve um pequeno declínio no seguimento de ações, fundo imobiliário e uma elevação em investimento no exterior, ou seja, dívida externa.

Liquidez

A carteira de investimentos possui liquidez imediata de 84,41% para auxílio no cumprimento das obrigações do RPPS.

Disponibilidade	Saldo	%
Liquidez Imediata	268.632.114,22	79,10%
D+30	18.023.979,66	5,31%
- 2 anos	5.678.121,19	1,67%
+ 3 anos	34.466.308,55	10,15%
Ilíquidos	12.794.109,16	3,77%
	339.594.632,78	

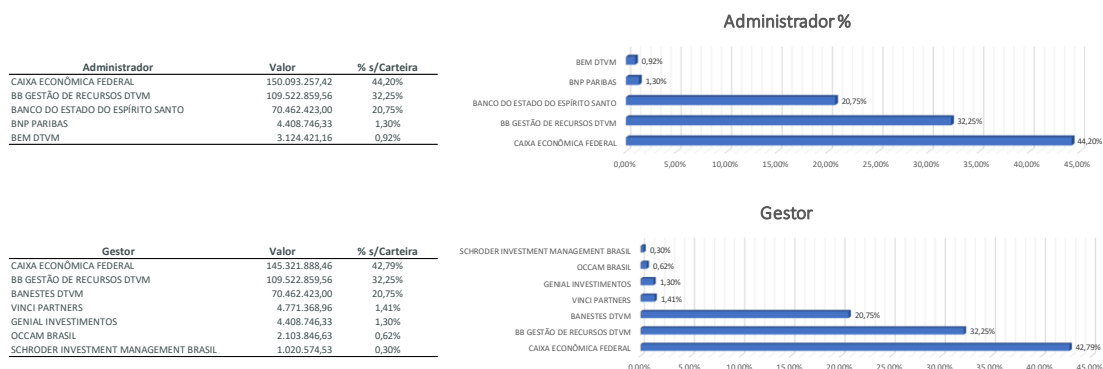


Indicamos aos gestores do IPC que a importância de compreender a necessidade da exposição da carteira de investimentos em ativos de menor liquidez, demonstra que os membros dirigentes objetivam retornos no longo prazo, possibilitam ao regime próprio arcar com seus compromissos futuros frente aos novos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

ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

Instituições Financeiras

Os fundos de investimentos que compõe a carteira de investimentos do RPPS, tem como prestadores de serviços de Administração e Gestão os:



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 DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO	✓	✓	✓	✓	✓
BANESTES DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
BEM DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
BNP PARIBAS	✓	✓	✓	✓	✓
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	✓	✓	✓	✓	✓
GENIAL INVESTIMENTOS	✗	✓	✓	✓	✓
OCCAM BRASIL	✗	✓	✓	✓	✓
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL	✗	✓	✓	✓	✓
VINCI PARTNERS	✗	✓	✓	✓	✓

Não foram identificadas situações atípicas nos prestadores de serviços ou Instituições Financeiras que pertencem a carteira de investimentos do IPC.

ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 09.594.596/0001-70)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 8287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos exclusivamente em títulos de emissão do Tesouro Nacional, registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) e/ou operações compromissadas lastreadas nesses títulos, a carteira do fundo deverá ter como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B da ANBIMA.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 268.980.362,71.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (89,52%) e por Operação compromissada (10,44%) que representam o montante de 99,96% do patrimônio do fundo.

A Administradora deu publicidade ao Fato Relevante, em 27 de julho de 2017, comunicando a alteração no horário para aplicação e resgate do fundo até às 17 horas, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais, a partir da data 01 de setembro de 2017.

Em 17 de março de 2020, através do Fato Relevante, a administradora informou que fechará o fundo para novas aplicações a partir do dia 17 de março de 2020 (inclusive), por prazo indeterminado, devido à alta volatilidade apresentada no mercado de juros nos últimos dias. E no dia 28 de maio de 2020, por um novo Fato Relevante, comunica a frente à redução da volatilidade observada no mercado de juros nos últimos dias, que o fundo será reaberto para novas aplicações a partir do dia 28 de maio de 2020 (inclusive).

Em 23 de dezembro de 2020, comunica, por publicação de Fato Relevante, que conforme deliberado em assembleia geral extraordinária realizada via consulta formal em 23 de dezembro de 2020, a partir do dia 22 de janeiro de 2021 a forma de cálculo da cota do fundo será alterada de “abertura” para “fechamento”.

Em 17 de maio de 2021, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante que informa alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do FUNDO serão alterados de 17 horas para 16 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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.

BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA (CNPJ: 21.005.667/0001-57)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 8287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar aplicados em ativos financeiros e 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\$ 177.653.174,46.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Operação compromissada (78,54%), Títulos Públicos Federais (21,41%) e derivativos (0,05%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

A Administradora deu publicidade ao Fato Relevante, em 27 de julho de 2017, comunicando a alteração no horário para aplicação e resgate do fundo até às 17 horas, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais, a partir da data 01 de setembro de 2017.

Em 17 de maio de 2021, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante que informa alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do FUNDO serão alterados de 17 horas para 16 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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\$ 6.941.606.073,67.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (67,69%) e por Operação compromissada (32,31%) 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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.303.793/0001-46)

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 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., inscrita no CNPJ sob o nº 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., sociedade de economia mista, inscrito no CNPJ sob n.º 00.000.000/0001-91, por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos 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\$ 520.079.165,42.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (99,93%) e por Operação compromissada (0,05%) que representam o montante de 99,98% do patrimônio do fundo.

A administradora deu publicidade ao Fato Relevante, no dia 08 de junho de 2018, comunicando a reabertura do fundo para novas aplicações a partir do dia 11 de junho de 2018, por tempo indeterminado.

Em 19 de junho de 2018, publicou um novo Fato Relevante que informa o fechamento do FUNDO para novas aplicações a partir do dia 19 de junho de 2018, por prazo indeterminado.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março 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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.303.795/0001-35)

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 taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo possui prazo de carência para resgate de cotas até o dia 15 de agosto de 2024.

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 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).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 584.471.174,11.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (99,90%) e por Operação compromissada (0,08%) que representam o montante de 99,98% do patrimônio do fundo.

A administradora deu publicidade ao Fato Relevante, no dia 29 de junho de 2018, informando que em virtude de decisões judiciais proferidas pela 18ª Vara Cível de Aracaju-SE (processo 2018.008.1603.7) e 1ª Vara de Fazenda Pública da Comarca de Natal-RN (processo 080.3453-11.2018.8.20.0000), nas quais é determinada a realização de resgate total das cotas de titularidade de dois cotistas do fundo, e, para o obrigatório cumprimento das referidas decisões, buscando mitigar o risco de possíveis prejuízos aos demais cotistas, realizará em observância às disposições da Instrução CVM nº 577/16, capítulo 1, seção 2, subtítulo 2 (Ativos de Renda Fixa), item 12, letra b, a partir de 02 de julho de 2018 (inclusive), a reclassificação dos ativos da carteira do fundo de “mantidos até o vencimento” para “negociação”.

Em 19 de junho de 2018, publicou um novo Fato Relevante que informando que, em virtude da reclassificação dos ativos da carteira do fundo de “mantidos até o vencimento” para “negociação”, ocorrida em 02 de julho de 2018, conforme Fato Relevante divulgado em 29 de junho de 2018.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março 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 TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.523.305/0001-06)

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 taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo possui prazo de carência para resgate de cotas até o dia 15 de agosto de 2022. Findo este prazo, os cotistas poderão solicitar o resgate total ou parcial de suas cotas.

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 carteira diversificada de 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\$ 246.212.950,73.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (99,66%) e por Operação compromissada (0,29%) que representam o montante de 99,95% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes.

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 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 18.598.288/0001-03)

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 taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo possui prazo de carência para resgate de cotas que poderão ser solicitados a partir de 16 de agosto de 2024.

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 em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 458.950.025,61.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (99,85%) e operações compromissadas em título públicos (0,15%), 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.

CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 20.139.595/0001-78)

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 taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo possui prazo de carência para resgate de cotas que poderão ser solicitados a partir de 16 de agosto de 2024.

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 em carteira composta por títulos públicos federais, 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\$ 1.427.517.748,77.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (99,85%) e operações compromissadas em título públicos (0,15%), 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.

CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 19.769.046/0001-06)

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 taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

O fundo possui prazo de carência para resgate de cotas que poderão ser solicitados a partir de 16 de agosto de 2030.

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 em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 67.245.725,16.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (99,84%) e operações compromissadas em título públicos (0,15%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Em 18 de junho de 2020, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante, informando a reabertura do fundo para novas aplicações a partir de 18 maio 2020 (inclusive), conforme possibilidade prevista no Artigo 19 da Instrução Normativa nº 555 de 17 de dezembro de 2014.

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\$ 15.935.689.880,46.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% das cotas de fundo de investimentos, sendo o FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER SOBERANO RENDA FIXA ATIVA (CNPJ: 10.948.555/0001-13), onde 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.

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.

- 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\$ 18.713.236.475,85.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (57,93%) e operações compromissadas em título públicos (42,07%), 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 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 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.

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\$ 14.363.834.668,17.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (99,16%) e operações compromissadas em título públicos (0,84%), 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 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 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.

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\$ 7.606.396.263,31.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (84,41%) e operações compromissadas em títulos públicos (15,49%), que representam o montante de 99,9% 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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 14.508.605/0001-00)

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 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 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 (IRF-M).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.581.480.875,05.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (97,11%) e operações compromissadas em título públicos (2,89%), 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.

CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP (CNPJ: 10.646.895/0001-90)

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 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 qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, 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 subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B, por meio da aplicação dos recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias, 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\$ 2.818.884.270,28.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% de cotas de fundos, sendo o FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LONGO PRAZO (CNPJ: 10.740.739/0001-93), 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.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LONGO PRAZO (CNPJ: 10.740.739/0001-93)

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 qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, 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 subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B, por meio da aplicação em ativos financeiros de renda fixa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.328.301.744,71.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (92,90%), debêntures (2,67%), títulos privados (3,25%) e operações compromissadas (1,17%), 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.

BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 30.378.445/0001-70)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 8287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas rentabilidade através de investimentos 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 relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, ao fator de risco que dá nome à classe.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 146.161.754,56.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundos, sendo 42,91% do BANESTES LIQUIDEZ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26); 30,66% do fundo BANESTES INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA (CNPJ: 05.357.507/0001-10); e 26,45% do fundo BANESTES REFERENCIAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M1 (CNPJ: 21.005.667/0001-57), onde serão apresentados adequadamente a seguir.

Em 01 de novembro de 2019, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante informando alterações no valor de investimento inicial mínimo de R\$ 50.000,00 para R\$ 25.000,00, durante o período de 01 de novembro de 2019 a 29 de novembro de 2019, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais.

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.

- BANESTES LIQUIDEZ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 8287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar em ativos financeiros buscando acompanhar a variação do Certificado de Depósito Interbancário (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, 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\$ 2.078.287.927,99.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 0,92% de cotas de fundos, sendo o FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,60% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CREDZ (CNPJ: 24.761.946/0001-39); 0,62% do fundo BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (CNPJ: 35.818.950/0001-02); 0,45% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS X (CNPJ: 32.222.848/0001-51); 0,48% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I (CNPJ: 33.534.867/0001-86); 0,47% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CLIENTES BRF (CNPJ: 31.547.712/0001-59); 0,18% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS

NU (CNPJ: 27.732.843/0001-39); 0,14% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LF I (CNPJ: 17.474.548/0001-76); 0,16% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CONTOUR GLOBAL BRASIL (CNPJ: 29.505.630/0001-08); 0,07% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS IX (CNPJ: 26.287.908/0001-11); 0,05% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62); 0,01% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34). Quanto aos demais ativos, identificamos exposição em Operações Compromissadas (42,77%), Títulos Públicos Federais (30,65%), Debêntures (15,70%) e Títulos Privados (6,63%).

Em 01 de novembro de 2019, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante informando alterações no valor de investimento inicial mínimo de R\$ 50.000,00 para R\$ 25.000,00, durante o período de 01 de novembro de 2019 a 29 de novembro de 2019, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais.

E no dia 17 de maio de 2021, publicou um novo Fato Relevante que informa a alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do fundo serão alterados de 19 horas para 17:30 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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.

- BANESTES INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA (CNPJ: 05.357.507/0001-10)

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 pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 8287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ativos financeiros e 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\$ 250.505.159,03.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 2,17% de cotas de fundos, sendo 1,36% FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,60% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34); 0,19% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62). Quanto aos demais ativos, identificamos exposição em Títulos Públicos Federais (67,03%), Operações Compromissadas (22,21%) e Debêntures (8,42%).

Em 27 de julho de 2017, a administradora divulgou o Fato Relevante que informa alteração no horário para aplicação e resgate do fundo até às 17 horas, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais, a partir da data 01 de novembro de 2017.

Em 12 de agosto de 2018, a administradora publicou novo Fato Relevante divulgando que o fundo recebeu, na data de 12 de agosto de 2019, o valor de R\$ 429.133,97 (quatrocentos e vinte e nove mil, cento e trinta e três reais e noventa e sete centavos) relativos ao 5º rateio da Massa Falida do Banco Santos.

Em 01 de novembro de 2019, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante informando alterações no valor de investimento inicial mínimo de R\$ 50.000,00 para R\$ 25.000,00, durante o período de 01 de novembro de 2019 a 29 de novembro de 2019, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais.

Em 17 de março de 2020, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante informando que fechará o fundo para novas aplicações a partir do dia 17 de março de 2020 (inclusive), por prazo indeterminado, devido à alta volatilidade apresentada no mercado de juros nos últimos dias.

No dia 08 de maio de 2020, através do Fato Relevante a administradora divulga que o fundo recebeu, na presente data, o valor de R\$ 152.152,82 (cento e cinquenta e dois mil, cento e cinquenta e dois reais e oitenta e dois centavos) relativos ao 6º rateio da Massa Falida do Banco Santos. Em consequência do crédito recebido, o fundo pagará

título de honorários advocatícios de R\$ 5.325,35 (cinco mil, trezentos e vinte e cinco reais e trinta e cinco centavos) equivalente a 3,5% do valor total recebido.

Em 28 de maio de 2020, através do Fato Relevante a administradora informa comunica que, frente à redução da volatilidade observada no mercado de juros nos últimos dias, o FUNDO será reaberto para novas aplicações a partir do dia 28 de maio de 2020 (inclusive).

Em 23 de dezembro de 2020, foi publicado um novo Fato Relevante informando que conforme deliberado em assembleia geral extraordinária realizada via consulta formal em 23 de dezembro de 2020, a partir do dia 22 de janeiro de 2021 a forma de cálculo da cota do fundo será alterada de “abertura” para “fechamento”.

Em 24 de março de 2021, por publicação do Fato Relevante a administradora divulga que o fundo recebeu, na data de 24 de março de 2021, o valor de R\$ 171.171,92 (cento e setenta e um mil, cento e setenta e um reais e noventa e dois centavos) relativos ao 7º rateio da Massa Falida do Banco Santos. Em consequência do crédito recebido, o FUNDO pagará a título de honorários advocatícios o valor de R\$ 5.991,02 (cinco mil, novecentos e noventa e um reais e dois centavos) equivalente a 3,5% (três vírgula cinco por cento) do valor total recebido.

E no dia 17 de maio de 2021, publicou um novo Fato Relevante que informa a alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do fundo serão alterados de 19 horas para 17:30 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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 recentes, não havendo, portanto, fato a ser acrescentado no respectivo relatório.

- BANESTES REFERENCIAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M1 (CNPJ: 21.005.667/0001-57)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 8287 de 15 de abril

de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ativos financeiros e modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, conforme definido neste regulamento, 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\$ 177.653.174,46.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas (78,54%) e títulos públicos federais (21,41%), que representam o montante de 99,95% do patrimônio do fundo.

Em 28 de julho de 2017, a administradora divulgou o Fato Relevante que informa alteração no horário para aplicação e resgate do fundo até às 17 horas, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais, a partir da data 01 de novembro de 2017.

E no dia 17 de maio de 2021, publicou um novo Fato Relevante que informa a alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do fundo serão alterados de 19 horas para 17:30 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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.

BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO (CNPJ: 00.838.267/0001-52)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 8287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos exclusivamente em títulos públicos federais indexados ao CDI/SELIC ou em títulos públicos federais prefixados indexados e/ou sintetizados para CDI/SELIC, e/ou em operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais. Os títulos componentes da carteira deverão ter prazo máximo a decorrer de 375 (trezentos e setenta e cinco) dias, e prazo médio da carteira do fundo inferior a 60 (sessenta) dias.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 994.731.135,93.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 90,59% de operações compromissadas.

Em 07 de maio de 2020, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante informando a redução da taxa de administração do fundo para 2,60% (dois vírgula sessenta por cento) ao ano, a partir de 07 de maio de 2020, com a alteração da redação do artigo 5.1 do Regulamento do fundo, que passa a ser:

“5.1. Pela prestação dos serviços de administração do FUNDO, incluindo a gestão da carteira, as atividades de tesouraria, de controle e processamento dos ativos financeiros, a distribuição e a escrituração da emissão e resgate de cotas, o FUNDO pagará a título de taxa de administração o percentual anual fixo de 2,60% (dois vírgula sessenta por cento) sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO”.

Em 18 de junho de 2020, a administradora publicou novo Fato Relevante que divulga a redução da taxa de administração do fundo para 1,95% (um vírgula noventa e cinco por

cento) ao ano, a partir de 18 de junho de 2020, com a alteração da redação do artigo 5.1 do Regulamento do fundo, que passa a ser:

“5.1. Pela prestação dos serviços de administração do FUNDO, incluindo a gestão da carteira, as atividades de tesouraria, de controle e processamento dos ativos financeiros, a distribuição e a escrituração da emissão e resgate de cotas, o FUNDO pagará a título de taxa de administração o percentual anual fixo de 1,95% (um vírgula noventa e cinco por cento) sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO”.

Em 06 de agosto de 2020, a administradora publicou em Fato Relevante a informação de que haverá redução da taxa de administração do fundo para 1,70% (um vírgula setenta por cento) ao ano, a partir de 06 de agosto de 2020, com a alteração da redação do artigo 5.1 do Regulamento do fundo, que passa a ser:

“5.1. Pela prestação dos serviços de administração do FUNDO, incluindo a gestão da carteira, as atividades de tesouraria, de controle e processamento dos ativos financeiros, a distribuição e a escrituração da emissão e resgate de cotas, o FUNDO pagará a título de taxa de administração o percentual anual fixo de 1,70% (um vírgula setenta por cento) sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO”.

E no dia 17 de maio de 2021, publicou um novo Fato Relevante que informa a alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do fundo serão alterados de 19 horas para 17 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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.

BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 8287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ativos financeiros que buscam acompanhar a variação do Certificado de Depósito Interbancário (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\$ 2.078.287.927,99.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 0,92% de cotas de fundos, sendo o FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,60% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CREDZ (CNPJ: 24.761.946/0001-39); 0,62 % do BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (CNPJ: 35.818.950/0001-02); 0,45% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS X (CNPJ: 32.222.848/0001-51); 0,48% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I (CNPJ: 33.534.867/0001-86); 0,47% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CLIENTES BRF (CNPJ: 31.547.712/0001-59); 0,18% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS NU (CNPJ: 27.732.843/0001-39); 0,14% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LF I (CNPJ: 17.474.548/0001-76); 0,16% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CONTOUR GLOBAL BRASIL (CNPJ: 29.505.630/0001-08); 0,07% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS IX (CNPJ: 26.287.908/0001-11); 0,05% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62); 0,01% do

FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34. Quanto aos demais ativos, identificamos exposição em Operações Compromissadas (42,77%), Títulos Públicos Federais (30,65%), Debêntures (15,70%) e Títulos Privados (6,63%).

Em 01 de novembro de 2019, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante informando alterações no valor de investimento inicial mínimo de R\$ 50.000,00 para R\$ 25.000,00, durante o período de 01 de novembro de 2019 a 29 de novembro de 2019, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais.

E no dia 17 de maio de 2021, publicou um novo Fato Relevante que informa a alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do fundo serão alterados de 19 horas para 17:30 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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

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.

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

O Fundo tem como 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, além de ser destinado a receber recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, pelos Estados, pelo Distrito Federal ou por Municípios, sejam eles aplicados pelos Regimes Próprios ou pela União, pelos Governos Estaduais, pelo Distrito Federal ou por Prefeituras e EFPCs - Entidades Fechadas de Previdência Complementar.

Conforme a composição da carteira em abril de 2021, o patrimônio líquido constatado na CVMWeb foi de R 4.460.514.993,96.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 97% de cotas de fundos, essas não identificadas ou classificadas como “omitidas”, pois o administrador fez valer do Art. 56, parágrafo 3º, inciso II da Instrução CVM nº 555/2014.

Não foi encontrado registro de parecer do auditor independente.

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

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

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% pelas ações do BB TOP DI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 00.852.311/0001-89), que será detalhado a seguir.

Quanto ao patrimônio líquido constatado na CVMWeb para o mês de referência foi de R\$ 4.167.355.289,66.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 28 de setembro de 2018, referindo-se 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 25/02/2035), oriundas do Plano de Recuperação Judicial da OI S.A., que integram direta ou indiretamente a carteira de ativos do FUNDO.

No relatório de auditores independentes, realizado pela KPMG em 31 de março de 2020, sobre as demonstrações contábeis, a conclusão registrada é de que o Fundo está adequado aos aspectos regulamentares exigidos pela ICVM nº 555/14.

Não há documentos, para o período avaliado, relativos à Assembleia Geral de Cotistas ou atos exclusivos do Administrador, que possam corroborar para a elaboração deste relatório.

- BB TOP DI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 00.852.311/0001-89)

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.

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

O Fundo tem como 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, além de ser destinado a receber recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, pelos Estados, pelo Distrito Federal ou por Municípios, sejam eles aplicados pelos Regimes Próprios ou pela União, pelos Governos Estaduais, pelo Distrito Federal ou por Prefeituras e EFPCs - Entidades Fechadas de Previdência Complementar.

Conforme a composição da carteira em abril de 2021, o patrimônio líquido constatado na CVMWeb foi de R 24.100.874.961,49.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos federais (55,70%), títulos privados (21,96%), operação compromissada (12,75%) e debêntures (9,29%). Que representam (99,7%) do patrimônio do fundo.

Não foram localizados fatos relevantes.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de março de 2021, onde menciona demonstrações contábeis referidas apresentando adequadamente, em todos aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do BB Top DI Renda Fixa Fixa Referenciado DI Longo Prazo Fundo de Investimento, e o desempenho de suas operações para o exercício findo nessa data, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos fundos de investimentos regidos pela Instrução CVM nº 555.

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 IPCA III RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO (CNPJ: 14.091.645/0001-91)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de crédito privado, 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), 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, obtendo níveis de rentabilidade compatíveis com o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo – IPCA + 6,0% a.a.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 630.089.837,19.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (79,18%), títulos privados (14,09%), debêntures (6,39%) e operações compromissadas em título públicos (0,32%), que representam o montante de 99,98% do patrimônio do fundo.

Em 08 de junho de 2017, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante informando que o fundo permanecerá aberto para captação, mesmo atingindo o PL de R\$ 365.000.000,00 (trezentos e sessenta e cinco milhões de reais milhões), o que implicaria em seu fechamento, conforme divulgado ao mercado e aos cotistas através de Fato Relevante no dia 21 de novembro de 2016.

Em 31 de julho de 2017, através de novo Fato Relevante, a administradora informou o fechamento do fundo para novas aplicações a partir do dia 01 de agosto de 2017 (inclusive), por tempo indeterminado.

Em 17 de abril de 2018, foi publicado o Fato Relevante que informa a reabertura do fundo para novas aplicações a partir do dia 17 de abril de 2018. O fundo permanecerá aberto até atingir a captação de R\$ 100.000.000,00 (cem milhões de reais), e assim que alcançar este valor, será fechado para novas aplicações.

E no dia 07 de junho de 2019, a administradora publicou novo Fato Relevante informando o fechamento do fundo para novas aplicações a partir do dia 07 de junho de 2019, inclusive, por prazo indeterminado

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.

- TAE33

Trata-se de uma debênture emitida pela TRANSMISSORA ALIANÇA DE ENERGIA ELÉTRICA S.A., inscrita sob o CNPJ de nº 07.859.971/0001-30, cuja espécie de título é quirografária. Conforme dados disponibilizados pelo agente fiduciário em fontes públicas, o relatório de rating emitido pela Fitch Ratings apresentou rating AAA (bra).

- CART22

Trata-se de uma debênture emitida pela CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES S/A., inscrita sob o CNPJ de nº 10.531.501/0001-58, cuja espécie de título é quirografária. A Consultoria não obteve informação de quaisquer documentos disponibilizados em fontes públicas de informação em relação ao rating do ativo.

- PETR45

Trata-se de uma debênture emitida pela PETROLEO BRASILEIRO S/A – PETROBRAS., inscrito sob o CNPJ de nº 33.000.167/0001-01, cuja espécie de título é quirografária. A Consultoria não obteve informação de quaisquer documentos disponibilizados em fontes públicas de informação em relação ao rating do ativo.

- TERP34

Trata-se de uma debênture emitida pela Termopernambuco S.A., inscrita sob o CNPJ de nº 03.795.050/0001-0, cuja espécie do título é quirografária, sendo que os recursos captados por meio de sua emissão serão destinados ao financiamento da aquisição, pela emissora, de parte das ações representativas do capital social da Itapebi Geração de Energia S.A. (“Itapebi”) e o saldo remanescente será destinado para capital de giro da Emissora. Conforme relatório anual do agente fiduciário, emitido no exercício de 2017, o rating emitido pelo Pentágono S.A. DTVM foi de A+ Emissão.

- SULM23

Trata-se de uma debênture emitida pela SUL AMERICA S A., inscrita sob o CNPJ de nº 29.978.814/0001-87, cuja espécie de títulos é quirografária. A Consultoria não obteve informação de quaisquer documentos disponibilizados em fontes públicas de informação em relação ao rating do ativo.

- GEPA25

Trata-se de uma debênture emitida pela RIO PARANAPANEMA ENERGIA S.A., inscrita sob o CNPJ de nº 02.998.301/0001-81, cuja espécie de título é quirografária. A Consultoria não obteve informação de quaisquer documentos disponibilizados em fontes públicas de informação em relação ao rating do ativo.

- UNBAB2

Trata-se de uma debênture emitida pela UNIDAS S/A., inscrita sob o CNPJ de nº 04.437.534/0001-30, cuja espécie de títulos é quirografária. Conforme dados disponibilizados pelo agente fiduciário em fontes públicas, o relatório de rating emitido pela STANDARD & POOR'S RATINGS DO BRASIL LTDA., apresentou rating AAA.

- CSMGC3

Trata-se de uma debênture emitida pela COMPANHIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS COPASA MG, inscrita sob o CNPJ de nº 17.281.106/0001-03, cuja espécie de título é quirografária. A Consultoria não obteve informação de quaisquer documentos disponibilizados em fontes públicas de informação em relação ao rating do ativo.

- CMTR33

Trata-se de uma debênture emitida pela CEMIG GERACAO E TRANSMISSAO S/A., inscrita sob o CNPJ de nº 06.981.176/0001-58, cuja espécie de título é quirografária. A Consultoria não obteve informação de quaisquer documentos disponibilizados em fontes públicas de informação em relação ao rating do ativo.

- ECCR32

Trata-se de uma debênture emitida pela ECORODOVIAS CONCESSOES E SERVICOS S/A., inscrita sob o CNPJ de nº 08.873.873/0001-10, cuja espécie de título é quirografária. Conforme dados disponibilizados pelo agente fiduciário em fontes públicas, o relatório de rating emitido pela S&P Global Ratings, em 22 de março de 2019, foi de AAA.

- JSML28

Trata-se de uma debênture emitida pela JSL S/A., inscrita sob o CNPJ de nº 52.548.435/0001-79, cuja espécie de título é quirografária. Conforme dados disponibilizados pelo agente fiduciário em fontes públicas, o relatório de rating emitido pela STANDARD & POOR'S RATINGS DO BRASIL LTDA., apresentou rating AA, com vencimento em 15 de junho de 2021.

Quanto as Instituições Financeiras de emissão das Letras Financeiras, foram identificadas: (i) BANCO BRADESCO; (ii) BANCO SANTANDER e (iii) BANCO VOTORANTIM; (iv) BANCO SAFRA.

Não há documentos, para o período avaliado, relativos a Assembleia Geral de Cotistas ou atos exclusivos do Administrador, que possam corroborar para a elaboração deste relatório.

BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 08.018.849/0001-02)

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 pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo, Instituição Financeira Múltipla (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente credenciada pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório n.º 8287, de 15 de abril de 2005, gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo, Instituição Financeira Múltipla (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente credenciada pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários através do Ato Declaratório nº 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, a médio e longo prazo, ganhos de capital por meio do investimento de seus recursos primordialmente no mercado acionário, sem perseguir uma alta correlação com qualquer índice de ações específico disponível.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 241.795.177,26.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% das cotas de fundo de investimentos, sendo 99,62% do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.977.794/0001-64) e 0,38% do BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO (CNPJ: 00.838.267/0001-52), que serão apresentados adequadamente a seguir.

Em 05 de novembro de 2019, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante informando as alterações no valor de investimento inicial mínimo de R\$

5.000,00 para R\$ 2.500,00, durante o período de 01 a 29 de novembro de 2019, conforme disposto em sua Lâmina de Informações Essenciais.

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.

- BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.977.794/0001-64)

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 pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), devidamente credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 8695, de 20 de março de 2006, gerido pela BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM (CNPJ: 29.650.082/0001-00), devidamente credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 5968, de 10 de maio de 2000.

A prestação de serviço de custódia de valores mobiliários e tesouraria será feita pelo Banco BTG Pactual S.A (CNPJ: 30.306.294/0001-45), devidamente credenciado junto à CVM, de acordo com o Ato Declaratório nº 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo o buscar proporcionar aos seus quotistas a valorização de suas quotas através da aplicação em quotas do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES, inscrito no CNPJ sob o n.º 17.009.959/0001-90, gerido pela GESTORA ("FUNDO INVESTIDO"), bem como em outros títulos e modalidades operacionais permitidas pela regulamentação em vigor.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.947.905.302,72.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% pelas cotas do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 17.009.959/0001-90).

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.

BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES (CNPJ: 35.998.413/0001-91)

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 pelo BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 8.287 de 15 de abril de 2005, e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), Ato Declaratório nº 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo investir, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seu patrimônio líquido em cotas do BTG PACTUAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES, além de outros ativos financeiros disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, sem perseguir uma correlação com qualquer índice de ações ou benchmark específico.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 13.195.426,55.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo de investimento, sendo 99,44% no BTG PACTUAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 09.290.813/0001-38) e 1,06 no BANESTES LIQUIDEZ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26), que serão apresentados a seguir.

Não há Fatos Relevantes.

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.

- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 09.290.813/0001-38)

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), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 8.695, de 20 de março de 2006, e gerido pela BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM (CNPJ: 29.650.082/0001-00), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 5968 de em 10 de maio de 2000.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco BTG Pactual S.A. (CNPJ: 30.306.294/0001-45), Ato Declaratório nº 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo investir, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) em quotas do BTG Pactual Dividendos Master Fundo de Investimento de Ações.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 105.536.731,70.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo de investimento, sendo 99,98% no BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 18.969.955/0001-17).

Não há Fatos Relevantes.

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.

- BANESTES LIQUIDEZ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26)

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 BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 8287 de 15 de abril de 2005,

e gerido pela BANESTES Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A (CNPJ: 28.156.057/0001-01), devidamente credenciada pela CVM - Comissão de Valores Mobiliários como prestadora de serviços de administração de carteiras através do Ato Declaratório nº 3.484 de 07 de julho de 1995.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANESTES S.A. - Banco do Estado do Espírito Santo (CNPJ: 28.127.603/0001-78), Ato Declaratório nº 8.218, de 14 de março de 2005.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ativos financeiros que buscam acompanhar a variação do Certificado de Depósito Interbancário (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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.078.287.927,99.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo de investimento, sendo 0,92% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,60% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CREDZ (CNPJ: 24.761.946/0001-39); 0,62% no BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (CNPJ: 35.818.950/0001-02); 0,45% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS X (CNPJ: 32.222.848/0001-51); 0,48% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I (CNPJ: 33.534.867/0001-86); 0,47% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CLIENTES BRF (CNPJ: 31.547.712/0001-59); 0,18% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS NU (CNPJ: 27.732.843/0001-39); 0,14% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LF I (CNPJ: 17.474.548/0001-76); 0,16% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CONTOUR GLOBAL BRASIL (CNPJ: 29.505.630/0001-0); 0,07% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS IX (CNPJ: 26.287.908/0001-11); 0,05% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62); 0,01% no FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34). Quantos aos demais ativos, estão distribuídos em Operações Compromissadas (41,52%), Títulos Públicos Federais (29,45%), Debêntures (16,76%) e Títulos Privados (6,68%).

Em 01 de novembro de 2019, foi publicado pela administradora o Fato Relevante informando alterações no valor de investimento inicial mínimo de R\$ 500.000,00 para R\$ 250.000,00, durante o período de 01 de novembro de 2019 a 29 de novembro de 2019.

Em 17 de maio de 2021, a administradora publicou um novo Fato Relevante informando alteração nos horários de funcionamento do Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC, conforme Resolução BCB nº 55/2020 e Instrução Normativa BCB nº 63/2020, os horários limites para aplicação e resgate do fundo serão alterados de 19 horas para 17:30 horas a partir da data 01 de junho de 2021, inclusive.

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 AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES (CNPJ: 18.270.783/0001-99)

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 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), Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos preponderantemente, em cotas de fundos de investimento (FIs) direcionados para assumir posições em ações negociadas na Bolsa Brasileira (B3) pertencentes a diversos setores da economia, de forma a buscar as melhores oportunidades no mercado.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 517.304.066,30.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo de investimentos, sendo 10,09% do BB AÇÕES VALE FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 04.881.682/0001-40); 8,03% do BB TOP AÇÕES SETOR FINANCEIRO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 08.973.959/0001-15); 9,72% do BB TOP AÇÕES SETORIAL CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 08.973.939/0001-44); 6,42% do BB AÇÕES PETROBRAS I FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 30.518.554/0001-46); 3,96% do BB TOP AÇÕES EXPORTAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.149.221/0001-40); 4,52% do BB TOP AÇÕES TOTAL RETURN FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 18.324.946/0001-79); 3,27% do BB TOP AÇÕES SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.100.234/0001-24); 1,95% do BB AÇÕES ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 02.020.528/0001-58); 2,38% do BB TOP AÇÕES INFRAESTRUTURA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.451.187/0001-66); 1,97% do BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 01.578.474/0001-88); 1,79% do BB TOP AÇÕES AGRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 40.054.367/0001-02); 0,95% do BB TOP AÇÕES DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.100.230/0001-46); 0,72% do BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 36.178.569/0001-99); 1,62% do BB AÇÕES PETROBRAS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 03.920.413/0001-82); 0,04% do ISHARES S&P 500 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE ÍNDICE - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (CNPJ: 19.909.560/0001-91); 0,58% do BB TOP AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 09.635.615/0001-69); e 0,34% do BB ASSET AÇÕES EQUIDADE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE

INVESTIMENTO (CNPJ: 33.824.951/0001-34). Quanto aos demais ativos, estão distribuídos em Ações (22,70%), operações compromissadas (2,54%).

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 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 25 de setembro de 2019, foram deliberadas: (I) alteração do artigo 1º no que se refere a denominação social do Fundo passando a ser denominado BB Ações Alocação Fundo de Investimentos em Ações; II) alteração do artigo 3º do Regulamento passando a permitir aplicações de clientes pessoas físicas, jurídicas e RPPS; III) inclusão do parágrafo único do artigo 3º do Regulamento para adequação à Resolução CMN nº 3.922/10; e IV) alteração do artigo 12º do Regulamento para adequação à CMN nº 3.922/10. Tais deliberações passaram a vigorar em 28 de outubro de 2019.

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\$ 1.269.495.027,18.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% cotas do BB TOP AÇÕES QUANTITATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.877.986/0001-21).

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 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 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 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\$ 1.626.652.204,04.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundos de investimentos, sendo 3,07% do ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE e 2,29% do BB ETF IBOVESPA FUNDO DE INDICE. Quanto aos demais ativos, estão distribuídos em ações (64,03%) e operação compromissada (5,04%).

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

Trata-se de um fundo de investimento 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 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 do Fundo é a Caixa Econômica Federal, que está devidamente qualificada perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, 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 do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO – CNPJ: 30.036.209/0001-76, e dentro dos limites estabelecidos em sua política de investimento.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 557.695.457,37.

A carteira de investimentos do fundo é composta por cotas de fundos de investimentos, sendo 99,47% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO (CNPJ: 30.036.209/0001-76); e 0,6 do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), que serão devidamente 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 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.

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

Trata-se de um fundo de investimento 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 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 do Fundo é a Caixa Econômica Federal, que está devidamente qualificada perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, 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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 648.578.678,10.

A carteira de investimentos do fundo é composta por cotas de fundos de investimentos, sendo 1,22% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO. Quanto aos demais ativos, estão distribuídos em ações (97,73%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro 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.

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

Trata-se de um fundo de investimento 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 do Fundo é a Caixa Econômica

Federal, que está devidamente qualificada perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, 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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.882.960.390,11.

A carteira de investimentos do fundo é composta por títulos públicos federais (59,53%) e operações compromissadas (39,94%), que representam o montante de 99,47% 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.

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 VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES (CNPJ: 15.154.441/0001-15)

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 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 proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas do fundo CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES, doravante denominado FUNDO INVESTIDO, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 15.154.458/0001-72, administrado pela administradora e gerido pela gestora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.075.548.698,44.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% das cotas de fundo de investimentos, sendo o CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 15.154.458/0001-72), onde será apresentado adequadamente a seguir.

Em 23 de agosto de 2017, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante, informando a abertura do fundo para novas aplicações a partir da data de publicação do mesmo.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro 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 VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 15.154.458/0001-72)

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 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 aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da administração objetiva e concentrada de ações, bônus de subscrição, debêntures conversíveis e demais títulos de emissão de companhias abertas que passam por situações especiais e que, com o monitoramento adequado e, através do acompanhamento e participação contínuos das suas atividades, tem grande potencial para a distribuição contínua de dividendos.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.018.504.952,99.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (96,25%) e operações compromissadas (2,14%), que representam o montante de 98,39% 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 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 23 de outubro de 2020, foi deliberado a seguinte matéria: (i) Alteração da Política de Investimento, com a exclusão à menção do índice DI, na composição da carteira do fundo.

CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES (CNPJ: 14.507.699/0001-95)

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 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 proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas do fundo CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES, doravante denominado FUNDO INVESTIDO, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 15.154.458/0001-72, administrado pela administradora e gerido pela gestora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 830.674.052,36.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% das cotas de fundo de investimentos, sendo o CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 15.154.458/0001-72), onde será apresentado adequadamente a seguir.

Em 12 de junho de 2017, a administradora deu publicidade ao Fato Relevante, informando a abertura do fundo para novas aplicações a partir da data de publicação do mesmo.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro 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 VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 15.154.458/0001-72)

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 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 aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da administração objetiva e concentrada de ações, bônus de subscrição, debêntures conversíveis e demais títulos de emissão de companhias abertas que passam por situações especiais e que, com o monitoramento adequado e, através do acompanhamento e participação contínuos das suas atividades, tem grande potencial para a distribuição contínua de dividendos.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.075.774.318,10.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (96,25%) e operações compromissadas (2,14%), que representam o montante de 98,39% 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 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 23 de outubro de 2020, foi deliberado a seguinte matéria: (i) Alteração da Política de Investimento, com a exclusão à menção do índice DI, na composição da carteira do fundo.

OCCAM FIC AÇÕES (CNPJ: 11.628.883/0001-03)

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 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 3.067, de 06 de setembro de 1994.

A gestão da carteira do Fundo é exercida pela OCCAM Brasil Gestão de Recursos Ltda. (CNPJ: 27.916.161/0001-86), credenciada como Gestora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 15.821, de 11 de agosto de 2017.

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

O fundo tem por objetivo de investimento buscar o buscar retorno aos seus Cotistas através do investimento em cotas do OCCAM Fundo de Investimento de Ações (CNPJ: 11.616.482/0001-25 – Fundo Master).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.227.059.317,62.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99,30% de fundos de investimentos e por 0,40% de operação compromissada, que representam o montante de 99,7% 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 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 Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de abril de 2019 deliberou, a partir de 24 de abril de 2019: a) a substituição do antigo administrador do Fundo, BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. para BEM DTVM Ltda.; b) A substituição do prestador dos serviços de custódia, controladoria e tesouraria do Fundo para Banco Bradesco S.A.; c) Substituição do prestador de serviços de distribuição, agenciamento e colocação de cotas do Fundo pelo Genial Institucional CCTVM S.A; d) Manutenção do atual prestador de serviços de administração da carteira (gestão) do Fundo, qual seja, a Occam Brasil

Gestão de Recursos Ltda.; e) Manutenção dos prestadores de serviço de auditoria do Fundo; f) Manutenção da denominação social do Fundo; g) Alteração do foro do Fundo para Cidade de Deus; h) Exclusão das menções ao BNY Mellon, seus meios de contato e endereço, para inserção da nova Administradora; i) Consolidação do texto do regulamento do Fundo para refletir as alterações descritas.

O Instrumento Particular de Alteração realizado em 22 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 1 dia.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 07 de fevereiro de 2020 deliberou, a partir de 13 de fevereiro de 2020 a I) alteração do regulamento nos seguintes capítulos: 1) Da Política de Investimento e Identificação dos Fatores de Risco; 2) Da Administração e dos Prestadores de Serviços; 3) Da Remuneração e Demais Despesas do Fundo; 4) Da emissão e Resgate de Cotas e 5) Das Disposições Gerais; II) Inclusão, no Regulamento, dos seguintes capítulos: Da Política de Divulgação de Informações e de Resultados e da Tributação Aplicável.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 07 de fevereiro de 2020 deliberou, a partir de 16 de março de 2020 a I) alteração da Remuneração e Demais Despesas do Fundo, a fim de: a) reduzir a taxa de administração paga pelo Fundo de 3% para 2%; b) reduzir a taxa de administração máxima do Fundo de 3,5% para 2,5%.

CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18)

Trata-se de um fundo de investimentos, 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\$ 257.550.502,39.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% em cotas de fundo de investimentos, sendo 97,54% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.060.913/0001-10) e 2,58% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), 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 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 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”.

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”.

- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.060.913/0001-10)

Trata-se de um fundo de investimentos, 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\$ 11.707.172.620,85.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos (99,16%) e demais ativos, já que identificamos exposição em operações compromissadas lastradas em títulos públicos (0,84%). O montante representa 99,99% do patrimônio do fundo.

Foram localizados dois atos relevantes, publicados em 31 de janeiro de 2018 (referente ao fechamento do Fundo para novas aplicações a partir da data de publicação) e em 19 de junho de 2018 (referindo-se à reabertura do Fundo para novas aplicações a partir da data de publicação).

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.

- 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 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\$ 1.882.960.390,11.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos (59,53%) e demais ativos, já que identificamos exposição em operações compromissadas lastreadas em títulos públicos (39,94%). O montante representa 99,50% do patrimônio do fundo.

Não há Atos 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.

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 INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP (CNPJ: 30.036.235/0001-02)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado, 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\$ 2.736.511.998,28

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por operações compromissadas lastreadas em títulos públicos (51,86%) e títulos públicos (47,94%). O montante representa 99,80% 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.

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 (CNPJ: 17.098.794/0001-70)

Trata-se de um fundo de investimento imobiliário, constituído sob a forma de condomínio fechado, conforme dispõe a ICVM nº 472/2008, tendo prazo de duração indeterminado.

Não existe disposição legal específica que regule a possibilidade de solicitar resgate de cotas, contudo, seu regulamento prevê a admissão de negociação de suas cotas no mercado secundário única e exclusivamente em mercado de bolsa de valores.

De acordo com o regulamento o Fundo não haverá cobrança das taxas de ingresso ou saída aos cotistas.

O fundo de investimento tem como objetivo adquirir cotas de outros fundos de investimentos imobiliários a fim de proporcionar aos seus cotistas uma remuneração que supere o índice IFIX.

A administração do Fundo é feita pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, inscrita no CNPJ de nº 00.360.305/0001-04, sob a Co-gestão da RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA., inscrita no CNPJ de nº 03.864.607/0001-08, visto que Caixa Econômica também exerce o papel de gestora.

Quanto ao patrimônio do Fundo, em junho de 2021 se mostrou no valor de R\$ 146.942.178,56. E não foi possível identificar a composição da carteira.

No tocante as reuniões dos cotistas em Assembleia Geral e Consulta Formal, em 15 de maio de 2020, os cotistas do fundo deliberaram acerca das demonstrações financeiras do Fundo referentes ao exercício social findo em 31 de dezembro de 2019, por meio de Consulta Formal, cujo resultado fora a aprovação da pauta pela totalidade dos cotistas presentes.

Em 14 de agosto de 2020, os cotistas tornaram a se reunir por meio de Consulta Formal para deliberar acerca da alteração da definição de “Ativos de Renda Fixa”, do objetivo e da política de investimento do Fundo e das obrigações da Gestora, bem como a contratação do serviço de formador de mercado (*market maker*), a ser pago pelo Fundo e o desdobramento de cotas do Fundo na proporção de 10 (dez) novas cotas para cada cota existente (SPLIT). Após votação e apuração, por meio dos votos válidos enviados pelos Cotistas, todas as matérias constantes na Ordem do Dia foram aprovadas.

Em consonância ao que fora disposto acima, a Administradora publicou fato relevante em 17 de agosto de 2020, informando que o desdobramento de cotas do Fundo na proporção de 1:10, aprovado na assembleia do dia 14 de agosto, funcionará de forma que cada 1 (uma) cota do Fundo passará a corresponder a 10 (dez) cotas; assim, após o desdobramento, o total de cotas passará a ser de 1.575.760,00000000 cotas, com a consequente alteração do valor base de cada cota, na mesma proporção, permanecendo inalterado o somatório do valor das referidas cotas.

A posição de cotistas considerada para o desdobramento das cotas do Fundo será 09 de setembro de 2020, sendo assim, a partir de 10 de setembro de 2020, as cotas serão negociadas na forma desdobrada. As cotas resultantes do desdobramento serão creditadas aos cotistas em 14 de setembro de 2020. As cotas resultantes do desdobramento serão da mesma espécie e classe, conferindo aos seus titulares os mesmos direitos das cotas previamente existente.

A Administradora menciona, através de relatório gerencial do mês de setembro, último mês atualizado, que os movimentos no portfólio do Fundo, a gestão realizou algumas reduções no portfólio visando o ganho de capital em teses que já estão bem precificadas no mercado secundário e não acreditam que haverá um aumento da renda dos fundos no curto e médio prazo. Foi realizado reduções nas posições de Kinea Renda Imobiliária e CSHG Real Estate.

Sobre os investimentos realizados no mês, houve um aumento da parcela de Rio Bravo Renda Corporativa através da emissão de cotas ICVM 476 com o objetivo de aumentar a participação em fundos com lajes corporativas de qualidade e localizadas em regiões primárias. Também liquidamos a terceira e última parcela do fundo Blue Cap Logística, o qual deve iniciar a distribuição total de dividendos no mês de novembro.

Por fim, fora realizado compromisso de subscrição de Guardian Logística que irá liquidar no mês outubro de 2021. O fundo irá comprar ativos logísticos locados para empresas com bom risco de crédito através de contratos atípicos e a Cap Rates de aquisição muito acima dos que acompanhamos nas transações já realizadas no mercado imobiliário.

Não há atualização disponível nas fontes públicas de informação (CVMWeb) para o mês de referência deste relatório.

BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES (CNPJ: 28.578.936/0001-13)

Trata-se de um fundo de investimento imobiliário, constituído sob a forma de condomínio fechado, conforme dispõe a ICVM nº 472/2008, tendo prazo de duração indeterminado.

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 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, estando autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros negociados no exterior, observadas as disposições contidas no Artigo 98 da Instrução CVM nº 555/14.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.159.128.591,79.

A carteira de investimentos do fundo é composta por 97,95% de investimentos no exterior.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro 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.

GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.331.342/0001-02)

Trata-se de um fundo de investimento imobiliário, constituído sob a forma de condomínio fechado, conforme dispõe a ICVM nº 472/2008, tendo prazo de duração indeterminado.

O Fundo é administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A. (CNPJ: 01.522.368/0001-82), devidamente autorizado a prestar os serviços de administração de carteiras de valores mobiliários por meio do Ato Declaratório CVM nº 4.448, de 21 de agosto de 1997.

A gestora é a Plural Investimentos Gestão de Recursos Ltda. (CNPJ: 09.630.188/0001-26), sociedade autorizada pela CVM a prestar o serviço de gestão de carteira de valores mobiliários através do Ato Declaratório nº 10.119, de 19 de novembro de 2008.

O responsável pelos serviços de Registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do Fundo é o Banco BNP Paribas Brasil S.A. (CNPJ: 01.522.368/0001-82), devidamente autorizado a prestar os serviços de custódia de valores mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº 6.628 de 13 de dezembro de 2001.

O fundo tem por objetivo proporcionar a seus cotistas, valorizações de suas cotas por meio de uma carteira composta por ativos financeiros negociados no exterior. Para tanto, o patrimônio líquido do FUNDO deverá estar alocado no mínimo em 95% no GENIAL MS GLOBAL BRANDS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INVESTIMENTO NO EXTERIOR, inscrito no CNPJ sob o nº 37.331.285/0001-53, cuja política de investimento consiste em aplicar até 100% de seus recursos em ativos financeiros emitidos e/ou negociados no exterior.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 134.816.055,48.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta exclusivamente por cotas de fundos de investimentos, essas não identificadas ou classificados como “omitidas”, pois o administrador fez valer do Art. 56, parágrafo 3º, inciso II da Instrução CVM nº 555/2014.

Não há Fatos Relevantes publicados.

Não foi encontrado registro de parecer do auditor independente.

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.

GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.331.365/0001-09)

Trata-se de um fundo de investimento imobiliário, constituído sob a forma de condomínio fechado, conforme dispõe a ICVM nº 472/2008, tendo prazo de duração indeterminado.

O Fundo é administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A. (CNPJ: 01.522.368/0001-82), devidamente autorizado a prestar os serviços de administração de carteiras de valores mobiliários por meio do Ato Declaratório CVM nº 4.448, de 21 de agosto de 1997.

A gestora é a Plural Investimentos Gestão de Recursos Ltda. (CNPJ: 09.630.188/0001-26), sociedade autorizada pela CVM a prestar o serviço de gestão de carteira de valores mobiliários através do Ato Declaratório nº 10.119, de 19 de novembro de 2008.

O responsável pelos serviços de Registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do Fundo é o Banco BNP Paribas Brasil S.A. (CNPJ: 01.522.368/0001-82), devidamente autorizado a prestar os serviços de custódia de valores mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº 6.628 de 13 de dezembro de 2001.

O fundo tem por objetivo proporcionar a seus cotistas, valorizações de suas cotas por meio de uma carteira composta por ativos financeiros negociados no exterior. Para tanto, o patrimônio líquido do FUNDO deverá estar alocado no mínimo em 95% no GENIAL MS US GROWTH FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INVESTIMENTO NO EXTERIOR, inscrito no CNPJ sob o nº 37.331.299/0001-77, cuja política de investimento consiste em aplicar até 100% de seus recursos em ativos financeiros emitidos e/ou negociados no exterior.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 466.045.366,70.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta exclusivamente por cotas de fundos de investimentos, essas não identificadas ou classificados como “omitidas”, pois o administrador fez valer do Art. 56, parágrafo 3º, inciso II da Instrução CVM nº 555/2014.

Não há Fatos Relevantes publicados.

Não foi encontrado registro de parecer do auditor independente.

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.

SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.308.394/0001-50).

Trata-se de um fundo de investimento 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 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA., inscrita no CNPJ/ME 00.066.670/0001-00, credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório no 3.067, de 06.09.1994, doravante denominada Administradora.

A gestão da carteira do Fundo é exercida pela SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA., CNPJ/ME sob o nº 92.886.662/0001-29, credenciada como Administradora de Carteira de valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório no 6.816, de 10.05.2002, doravante denominada Gestora.

A custódia, tesouraria e controladoria dos ativos financeiros do Fundo é realizada pelo BANCO BRADESCO S.A., inscrito no CNPJ/ME sob o nº 60.746.948/0001-12, pelo Ato Declaratório no 1.432, de 27.06.1990.

O Fundo tem por objetivo buscar retorno aos seus Cotistas através de investimentos em cotas do SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES – INVESTIMENTO NO EXTERIOR, inscrito no CNPJ/ME sob o nº 37.308.317/0001-08 (Fundo Master), com o compromisso de concentração em renda variável e índices de ações, podendo incorrer também os seguintes fatores de risco: taxa de juros pós-fixadas, taxa de juros pré-fixadas, índices de preço, variação cambial e derivativos, desde que respeitadas as regras e os limites impostos pela legislação vigente, conforme política descrita no Artigo 5º.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 244.602.296,68.

A carteira de investimentos do fundo é composta por fundos de investimento (99,68%) sendo ele o (SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES CNPJ: 37.308.317/0001-08), que será apresentado a seguir, e operação compromissada (0,32%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis, apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Schroder Sustentabilidade Ações Globais Fundo de Investimento em Cotas de Fundo de Investimento em Ações - Investimento no Exterior em 31 de março de 2021 e o desempenho de suas operações para o período de 10 de agosto de 2020 (data de início das atividades do Fundo) a 31 de março de 2021, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos Fundos de investimento regulamentados

pela Instrução da Comissão de Valores Mobiliários - CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014.

Não foram identificadas assembleias gerais de cotistas.

- SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES INVESTIMENTO FI AÇÕES (CNPJ: 37.308.317/0001-08)

Trata-se de um fundo de investimento 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 BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA., inscrita no CNPJ/ME 00.066.670/0001-00, credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório no 3.067, de 06.09.1994, doravante denominada Administradora.

A gestão da carteira do Fundo é exercida pela SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA., CNPJ/ME sob o nº 92.886.662/0001-29, credenciada como Administradora de Carteira de valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório no 6.816, de 10.05.2002, doravante denominada Gestora.

A custódia, tesouraria e controladoria dos ativos financeiros do Fundo é realizada pelo BANCO BRADESCO S.A., inscrito no CNPJ/ME sob o nº 60.746.948/0001-12, pelo Ato Declaratório no 1.432, de 27.06.1990.

O Fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade por meio das oportunidades oferecidas preponderantemente pelo mercado de renda variável, não obstante, o Fundo poderá aproveitar oportunidades através de investimentos em outras classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo, vedada a alavancagem.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 271.622.018,33.

A carteira de investimentos do fundo é composta por investimentos no exterior (99,18%) e operações compromissadas (0,54%), totalizando 99,72 do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis, referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes que a posição patrimonial e financeira do Schroder Sustentabilidade Ações Globais Fundo de Investimento em Ações - Investimento no Exterior em 31 de março de 2021 e o desempenho de suas operações para o período de 10 de agosto de 2020 (data de início

das atividades do Fundo) a 31 de março de 2021, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos Fundos de investimento regulamentados pela Instrução da Comissão de Valores Mobiliários - CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014.

O Instrumento Particular realizado em 23 de novembro de 2020 deliberou, a partir de 23 de dezembro de 2020, sobre a alteração do regulamento do Fundo nos capítulos: “Do Público Alvo”, “Da Política de Investimento e Identificação dos Fatores de Risco” e “Da Assembleia Geral de Cotistas”.

CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES (CNPJ: 17.502.937/0001-68)

Trata-se de um fundo de investimento imobiliário, constituído sob a forma de condomínio fechado, conforme dispõe a ICVM nº 472/2008, tendo prazo de duração indeterminado.

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 do Fundo é a Caixa Econômica Federal, que está devidamente qualificada perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

O fundo tem por objetivo é 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, 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\$ 3.076.433.383,80.

A carteira de investimentos do fundo é composta por: Brazilian Depositary Receipts - BDRs (98,53%), cotas do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00) 0,85%, que será apresentado adequadamente a seguir, e em Investimento no exterior (0,16%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro 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.

CONCLUSÃO

Da análise apresentada, havendo fundos de investimentos que apresentem classificação de estruturados ou possuem operações com títulos e/ou papéis em operações estruturadas, concluímos que o IPC, não somente contemplando a emissão desse relatório, venha adquirir a habitualidade de acompanhar com proximidade todas as ações promovidas pelos fundos de investimentos, principalmente das Instituições Financeiras a eles tidos como prestadores de serviços.

Orientamos também, em complemento, que o IPC venha adotar, regras, procedimentos e controles internos que integrem o fluxo de atividades e manuais de procedimentos na adequação da análise de fundos de investimentos que contemplam sua carteira de investimentos.

A aplicação do Plano de Contingência deverá ocorrer caso haja o descasamento dos 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 de Contingência.

Orientamos para que, além da Política de Investimentos apresentar o Plano de Contingência, o IPC 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 IPC se mostra diversificada em um grau arrojado, 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 III, o IPC 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.

Na busca pelo casamento do ativo e passivo, o IPC buscou no ALM – Asset Liability Management a demonstração desse casamento, onde houve a segurança da liquidez da carteira de investimentos em honrar os compromissos presentes e futuros e, na busca pela otimização da sua carteira de investimentos, não somente no cumprimento no longo prazo da sua meta atuarial, mas também na resguarda do resultado positivo financeiros também no longo prazo.

Sugerimos que o IPC 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 IPC, 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 atenda ao sétimo mês do exercício de 2021.

Permanecemos à disposição para eventuais esclarecimentos.

Atenciosamente,



Renan Foglia Calamita

Pós-Graduação em *Advanced Program in Finance*
CEA e CGA Anbima / Economista
Consultor de Valores Mobiliários



Samanta Zaniquelli Delcore

MBA em Gestão Financeira, Controladoria e Auditoria
CPA-10 Anbima / Consultor de Valores Mobiliários
Compliance Officer

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.