



## RELATÓRIO DE DILIGÊNCIA E ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO

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



## SUMÁRIO

|                                                                                            |           |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|
| <b>INTRODUÇÃO .....</b>                                                                    | <b>4</b>  |
| <b>ANÁLISE DE CARTEIRA .....</b>                                                           | <b>5</b>  |
| Composição da Carteira de Investimentos .....                                              | 5         |
| Casamento de Ativo e Passivo .....                                                         | 8         |
| Evolução Patrimonial .....                                                                 | 9         |
| Rentabilidade .....                                                                        | 10        |
| Controle de Risco .....                                                                    | 11        |
| Históricos de Movimentações .....                                                          | 12        |
| Liquidez .....                                                                             | 15        |
| <b>ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS .....</b>                       | <b>16</b> |
| Instituições Financeiras .....                                                             | 16        |
| Análise da Situação das Instituições Financeiras .....                                     | 16        |
| <b>ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS .....</b>                          | <b>17</b> |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 09.594.596/0001-70) .....               | 17        |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA (CNPJ: 21.005.667/0001-57) .....                | 19        |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.111.384/0001-69) .....    | 21        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.303.793/0001-46) .....   | 22        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.303.795/0001-35) ..... | 23        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.523.305/0001-06) .....      | 25        |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 18.598.288/0001-03) .....        | 26        |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 20.139.595/0001-78) .....       | 27        |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 19.769.046/0001-06) .....       | 28        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 23.215.097/0001-55) .....            | 29        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 11.060.913/0001-10) .....    | 32        |



## CRÉDITO & MERCADO

|                                                                                                       |    |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 10.740.670/0001-06)                        | 33 |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 14.508.605/0001-00)                       | 34 |
| 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)                 | 50 |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP (CNPJ: 10.646.895/0001-90)                     | 52 |
| BB IPCA III RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO (CNPJ: 14.091.645/0001-91)                      | 54 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES (CNPJ: 11.392.165/0001-72)                                          | 56 |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 08.018.849/0001-02)                      | 59 |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES (CNPJ: 35.998.413/0001-91)                                              | 63 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES (CNPJ: 18.270.783/0001-99)                                                 | 67 |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 07.882.792/0001-14)                                                  | 74 |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES (CNPJ: 09.005.805/0001-00)                                                 | 77 |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES (CNPJ: 30.068.169/0001-44)                            | 80 |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES (CNPJ: 15.154.441/0001-15)                         | 84 |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES9 (CNPJ: 14.507.699/0001-95)                                   | 88 |
| OCCAM FIC AÇÕES (CNPJ: 11.628.883/0001-03)                                                            | 92 |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES (CNPJ: 28.578.936/0001-13) | 95 |
| BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO (CNPJ: 17.431.816/0001-72)                       | 96 |



## CRÉDITO & MERCADO

|                                                                                                             |            |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.331.342/0001-02) .....                 | 97         |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.331.365/0001-09) .....                     | 99         |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES (CNPJ: 37.308.394/0001-50) ..... | 101        |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES (CNPJ: 17.502.937/0001-68) .....                                   | 104        |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18) .....                          | 106        |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP (CNPJ: 30.036.235/0001-02) .....                            | 109        |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 (CNPJ: 17.098.794/0001-70)... ..                               | 111        |
| <b>CONCLUSÃO .....</b>                                                                                      | <b>112</b> |
| <b>DISCLAIMER .....</b>                                                                                     | <b>114</b> |



## 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

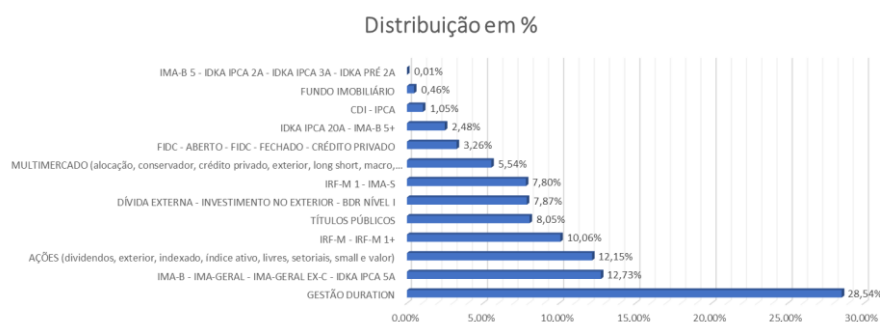
### Carteira de Investimentos – fevereiro/2022

| Produto / Fundo                                                            | Benchmark                   | Disponibilidade       | Carência      | Saldo                 | Carteira % |
|----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|-----------------------|---------------|-----------------------|------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                                           | TÍTULOS PÚBLICOS            |                       |               | 28.225.049,28         | 8,05%      |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                                | IMA-B                       | D+0                   | Não há        | 12.285.521,59         | 3,50%      |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                                 | IRF-M 1                     | D+1                   | Não há        | 19.925.497,85         | 5,68%      |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | IRF-M                       | D+1                   | Não há        | 15.687.764,08         | 4,47%      |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                    | IMA-B                       | D+0                   | 15/08/2022    | 5.117.700,18          | 1,46%      |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                  | IMA-B                       | D+0                   | 15/08/2024    | 7.012.421,57          | 2,00%      |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | IMA-B                       | D+0                   | 15/08/2022    | 544.309,13            | 0,16%      |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                         | IMA-B                       | D+0                   | 16/08/2024    | 8.461.170,00          | 2,41%      |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | IMA-B                       | D+0                   | 15/08/2024    | 9.572.212,50          | 2,73%      |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | IMA-B 5+                    | D+0                   | 15/08/2030    | 8.706.875,00          | 2,48%      |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                             | GESTÃO DURATION             | D+0                   | Não há        | 38.774.874,61         | 11,05%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                     | IMA-B 5                     | D+0                   | Não há        | 26.621,07             | 0,01%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | IRF-M 1                     | D+0                   | Não há        | 7.450.455,93          | 2,12%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                       | IRF-M                       | D+0                   | Não há        | 19.619.800,26         | 5,59%      |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA                                         | GESTÃO DURATION             | D+2                   | Não há        | 19.883.394,39         | 5,67%      |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO                   | CDI                         | D+0                   | Não há        | 481.468,96            | 0,14%      |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                            | CDI                         | D+0                   | Não há        | 2.644.050,56          | 0,75%      |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | GESTÃO DURATION             | D+3                   | Não há        | 41.455.842,59         | 11,82%     |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP                 | CDI                         | D+0                   | Não há        | 544.100,82            | 0,16%      |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP                     | IMA-B                       | D+0                   | Não há        | 1.658.443,98          | 0,47%      |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO                   | CRÉDITO PRIVADO             | D+30 ou D+30 a D+2880 | Não há        | 11.436.508,35         | 3,26%      |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES                                          | AÇÕES - SMALL / MID CAPS    | D+30                  | Não há        | 1.158.253,22          | 0,33%      |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                      | AÇÕES - LIVRES              | D+34                  | Não há        | 11.501.794,19         | 3,28%      |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES                                              | AÇÕES - DIVIDENDOS          | D+5 du                | Não há        | 1.698.468,62          | 0,48%      |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                                                 | AÇÕES - LIVRES              | D+4                   | Não há        | 7.478.536,83          | 2,13%      |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                                                  | AÇÕES - LIVRES              | D+3                   | Não há        | 3.894.031,32          | 1,11%      |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                                                 | AÇÕES - LIVRES              | D+3                   | Não há        | 1.771.675,80          | 0,51%      |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES                            | AÇÕES - LIVRES              | D+15                  | Não há        | 7.701.403,07          | 2,20%      |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES                         | AÇÕES - DIVIDENDOS          | D+33                  | Não há        | 1.631.602,78          | 0,47%      |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES                                    | AÇÕES - VALOR               | D+23                  | Não há        | 2.851.352,71          | 0,81%      |
| OCCAM FIC AÇÕES                                                            | AÇÕES - VALOR               | D+4 ou D+18           | Não há        | 2.939.416,15          | 0,84%      |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES | AÇÕES - EXTERIOR            | D+5 du                | Não há        | 5.239.927,82          | 1,49%      |
| BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO                       | AÇÕES - EXTERIOR            | D+5 du                | Não há        | 1.034.888,20          | 0,30%      |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                 | AÇÕES - EXTERIOR            | D+6 du                | Não há        | 1.709.339,49          | 0,49%      |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                     | AÇÕES - EXTERIOR            | D+6 du                | Não há        | 2.103.623,00          | 0,60%      |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | AÇÕES - EXTERIOR            | D+4 du                | Não há        | 1.531.569,04          | 0,44%      |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                   | AÇÕES - EXTERIOR            | D+4                   | Não há        | 15.974.622,34         | 4,55%      |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP                          | MULTIMERCADO - MODERADO     | D+15                  | Não há        | 8.912.296,88          | 2,54%      |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                            | MULTIMERCADO - EXTERIOR "d" | D+1                   | Não há        | 10.525.951,20         | 3,00%      |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11                               | FUNDO IMOBILIÁRIO           | Não se aplica         | Não se aplica | 1.624.500,00          | 0,46%      |
|                                                                            |                             |                       |               | <b>350.797.335,36</b> |            |

Fonte: Sistema Crédito e de Mercado posição fevereiro de 2022

### Distribuição Estratégica – fevereiro/2022

| Sub-Segmento                                                                                    | Posição R\$           | %              |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|----------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                                                                | 28.225.049,28         | 8,05%          |
| GESTÃO DURATION                                                                                 | 100.114.111,59        | 28,54%         |
| IDKA IPCA 20A - IMA-B 5+                                                                        | 8.706.875,00          | 2,48%          |
| IMA-B - IMA-GERAL - IMA-GERAL EX-C - IDKA IPCA 5A                                               | 44.651.778,95         | 12,73%         |
| IRF-M - IRF-M 1+                                                                                | 35.307.564,34         | 10,06%         |
| IMA-B 5 - IDKA IPCA 2A - IDKA IPCA 3A - IDKA PRÉ 2A                                             | 26.621,07             | 0,01%          |
| IRF-M 1 - IMA-S                                                                                 | 27.375.953,78         | 7,80%          |
| CDI - IPCA                                                                                      | 3.669.620,34          | 1,05%          |
| POUPANÇA - OP COMPROMISSADAS - CDB - CVS - DISPONIBILIDADE                                      | 0,00                  | 0,00%          |
| FIDC - ABERTO - FIDC - FECHADO - CRÉDITO PRIVADO                                                | 11.436.508,35         | 3,26%          |
| AÇÕES (dividendos, exterior, indexado, índice ativo, livres, setoriais, small e valor)          | 42.626.534,69         | 12,15%         |
| MULTIMERCADO (alocação, conservador, crédito privado, exterior, long short, macro, moderado e i | 19.438.248,08         | 5,54%          |
| FUNDO IMOBILIÁRIO                                                                               | 1.624.500,00          | 0,46%          |
| FIP                                                                                             | 0,00                  | 0,00%          |
| DÍVIDA EXTERNA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR - BDR NÍVEL I                                         | 27.593.969,89         | 7,87%          |
|                                                                                                 | <b>350.797.335,36</b> | <b>100,00%</b> |



A carteira de investimentos do IPC está segregada entre os segmentos de renda fixa, renda variável e investimentos no exterior, sendo 73,98%, 18,16% e 7,87%, não ultrapassando o limite de 45% permitido pela Resolução CMN nº 4.963/2021 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 multimerado.

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

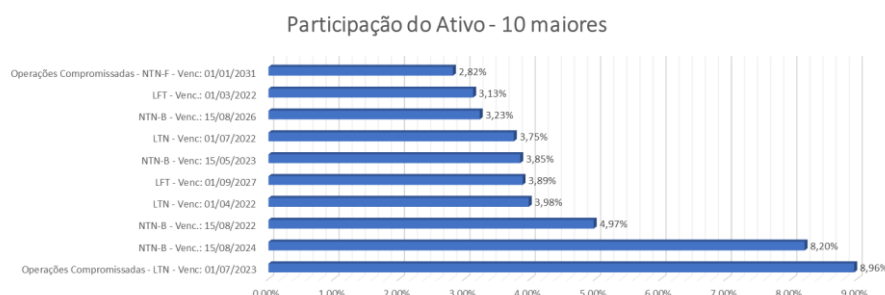
- **EXTERIOR:** fundos de investimentos que investem em ativos financeiros no exterior em parcela superior a 40% do patrimônio líquido. Estes fundos seguem o disposto no art. 101 da Instrução nº 555 da CVM. No âmbito dos fundos de investimentos classificados como Multimercado, o hedge cambial da parcela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

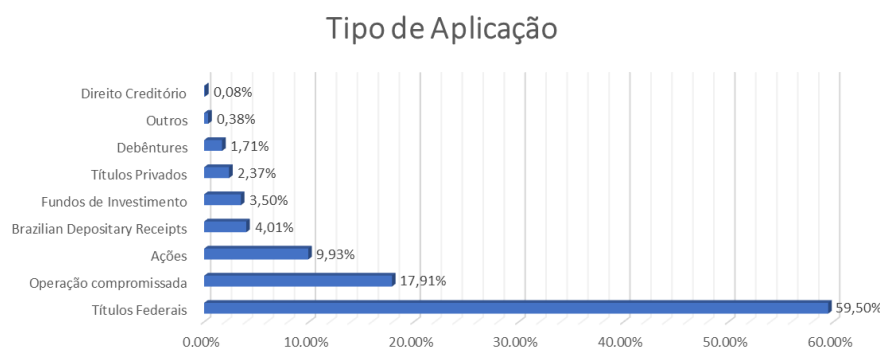
- **LIVRE OU MODERADO:** não tem o compromisso de concentração em alguma estratégia específica.

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

### Distribuição Consolidada da Carteira – fevereiro/2022



Ao analisarmos as dez maiores participações na carteira de investimentos do IPC, identificamos uma alta concentração em títulos públicos e operações compromissadas atreladas em títulos públicos.





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 77,41% do total do patrimônio. Há também participação em fundos de investimentos, ações, *Brazilian Depositary Receipts*, Títulos Privados e Debêntures que representam o somatório de 21,53% do total do patrimônio, além de outros demais ativos com baixa representatividade, que representam 0,46%.

#### 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.

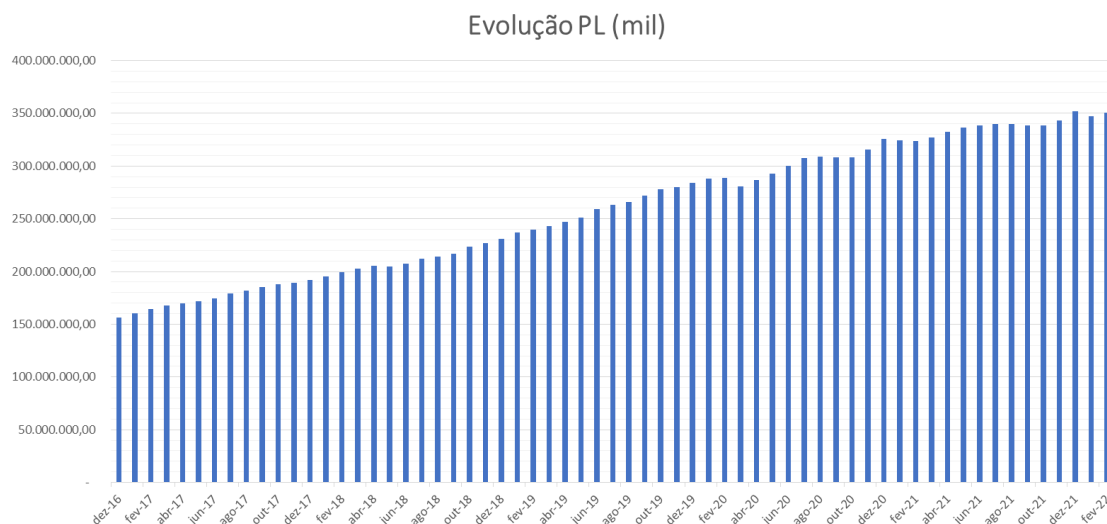
Ao analisarmos o relatório, podemos considerar que o fluxo de caixa previdenciário para os próximos 10 (anos) anos é positivo, ou seja, o IPC receberá valores provenientes de contribuições previdenciárias em volume superior aos compromissos previdenciários, havendo espaço para alongamento de parte dos 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 4.963/2021 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.

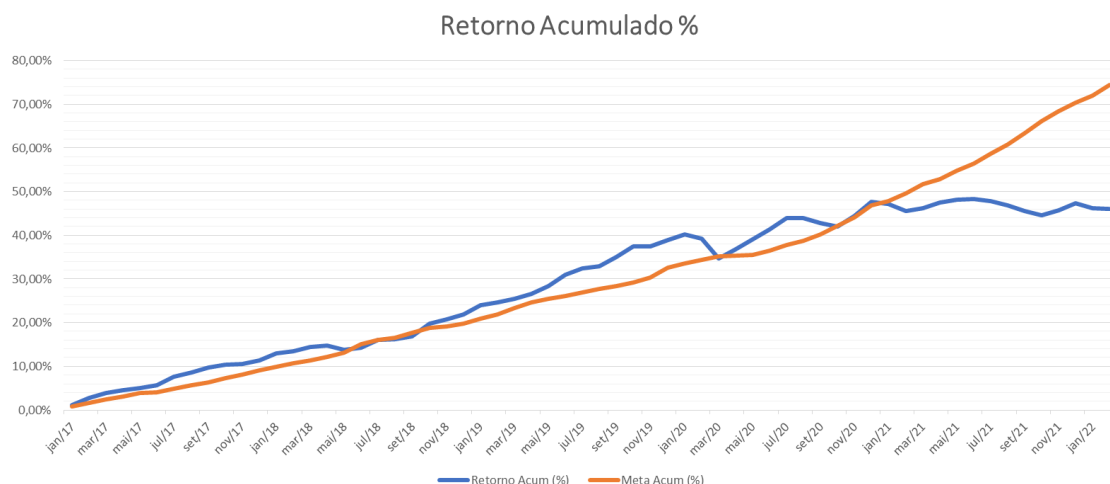
Ao final do mesmo período, observamos uma retomada no crescimento do patrimônio líquido, igualitário ou superior aos resultados apresentados antes ao declínio. É possível notar que o patrimônio líquido do IPC vem seguindo uma curvatura crescente e notória, acumulando mais recursos mês a mês.

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.



## CRÉDITO & MERCADO

### 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 consequentemente, novamente, voltar a superar a meta atuarial no longo prazo.

O não atingimento da meta de rentabilidade representa 74,44% de meta de rentabilidade estabelecida contra 46,08% 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% | -0,66% | -0,87% | -0,69% | 0,75% | 1,09% | -0,30% | 47,28% |
|      | Meta     | 0,68%  | 1,25%  | 1,43%  | 0,74% | 1,28%  | 0,98% | 1,43%  | 1,34%  | 1,61%  | 1,68%  | 1,38% | 1,22% | 16,09% | 70,43% |
| 2022 | Carteira | -0,68% | -0,14% |        |       |        |       |        |        |        |        |       |       | -0,82% | 46,08% |
|      | Meta     | 0,95%  | 1,39%  |        |       |        |       |        |        |        |        |       |       | 2,35%  | 74,44% |

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

Em se tratando da rentabilidade para o exercício de 2022, o IPC obteve no mês de referência o resultado de -0,14%, diminuindo o resultado acumulado para o mesmo exercício, equivalente a -0,82%. A meta de rentabilidade, por sua vez, fechou o mês de



## CRÉDITO & MERCADO

referência com o resultado de 1,39%, acumulando para o mesmo exercício o montante de 2,35%.

### 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 fevereiro 2022

|                           | Fevereiro de 2022 |                     |            |                |                 |
|---------------------------|-------------------|---------------------|------------|----------------|-----------------|
|                           | Retorno           | VaR (95% MV 21 dia) | Renda Fixa | Renda Variável | Invst. Exterior |
| Carteira de Investimentos | -0,14%            | 3,23%               | 1,12%      | 6,43%          | 13,50%          |

| Produto / Fundo                                                            | Fevereiro de 2022 |              |                     |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|                                                                            | Retorno           | Volatilidade | VaR (95% MV 21 dia) |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                    | 1,96%             | 1,09%        | 0,52%               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 1,96%             | 1,09%        | 0,52%               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                  | 1,74%             | 1,35%        | 0,64%               |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                     | 1,52%             | 2,17%        | 1,03%               |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                 | 1,41%             | 23,26%       | 11,04%              |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO                   | 1,34%             | 2,65%        | 1,26%               |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                         | 1,22%             | 2,76%        | 1,31%               |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | 1,22%             | 2,76%        | 1,31%               |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | 0,95%             | 6,26%        | 2,97%               |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                             | 0,88%             | 0,83%        | 0,39%               |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11                               | 0,80%             | 17,50%       | 8,31%               |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP                     | 0,78%             | 4,99%        | 2,37%               |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                            | 0,78%             | 0,08%        | 0,04%               |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA                                         | 0,74%             | 0,80%        | 0,38%               |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                                 | 0,74%             | 0,32%        | 0,15%               |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP                 | 0,74%             | 0,06%        | 0,03%               |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | 0,68%             | 0,52%        | 0,25%               |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                                | 0,62%             | 5,14%        | 2,44%               |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | 0,59%             | 1,86%        | 0,88%               |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO                   | 0,59%             | 0,01%        | 0,00%               |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP                          | 0,22%             | 3,24%        | 1,54%               |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | -0,16%            | 3,19%        | 1,51%               |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                       | -0,23%            | 3,13%        | 1,49%               |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES                            | -1,10%            | 13,72%       | 6,51%               |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES | -2,18%            | 23,20%       | 11,01%              |
| BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO                       | -3,25%            | 24,80%       | 11,78%              |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | -3,96%            | 24,85%       | 11,80%              |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                   | -4,14%            | 21,87%       | 10,39%              |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES                                          | -4,50%            | 14,65%       | 6,96%               |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES                         | -4,78%            | 14,46%       | 6,87%               |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES                                              | -4,81%            | 10,75%       | 5,10%               |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                            | -5,31%            | 24,41%       | 11,59%              |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                                                  | -6,26%            | 17,70%       | 8,41%               |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                                                 | -6,47%            | 17,34%       | 8,23%               |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                                                 | -7,01%            | 17,40%       | 8,26%               |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES                                    | -7,37%            | 16,27%       | 7,73%               |
| OCCAM FIC AÇÕES                                                            | -7,46%            | 15,80%       | 7,50%               |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                      | -9,22%            | 17,32%       | 8,23%               |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                     | -17,22%           | 42,62%       | 20,24%              |

\*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.



## CRÉDITO & MERCADO

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 2as 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 2022

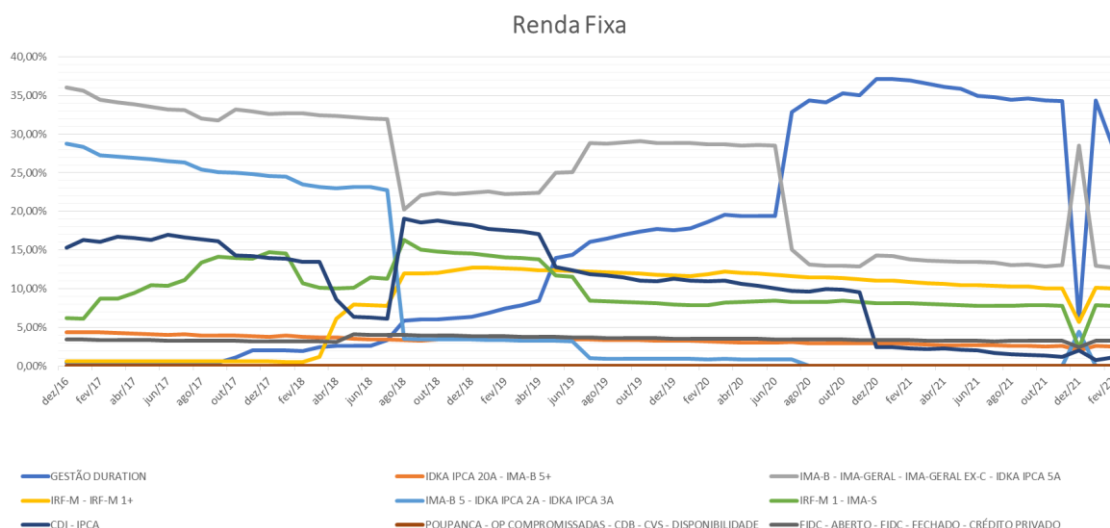
| Fundos de Investimentos                                                    | dez-21                | jan-22                | fev-22                |
|----------------------------------------------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                                | 11.194.859,29         | 12.235.432,05         | 12.285.521,59         |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | 51.048.889,44         | 9.715.312,50          | 9.572.212,50          |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                                 | 1.628.571,03          | 19.806.563,56         | 19.925.497,85         |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 2.157.927,13          | 553.967,89            | 544.309,13            |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                         | 19.676.529,44         | 8.607.820,00          | 8.461.170,00          |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | 19.617.800,12         | 15.599.176,36         | 15.687.764,08         |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | 6.582.500,44          | 7.396.843,90          | 7.450.455,93          |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                     | 15.619.055,79         | 26.344,21             | 26.621,07             |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                        | 6.967.568,17          | 8.888.835,00          | 8.706.875,00          |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                            | 5.176.190,47          | 1.669.759,32          | 2.644.050,56          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                    | 12.352.129,84         | 5.205.629,59          | 5.117.700,18          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                  | 353.407,08            | 7.132.059,62          | 7.012.421,57          |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP                 | 550.859,29            | 539.791,57            | 544.100,82            |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO                   | 8.610.515,00          | 11.320.475,03         | 11.436.508,35         |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES                         | 19.518.442,57         | 1.643.193,92          | 1.631.602,78          |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                                                 | 8.705.904,27          | 7.437.074,62          | 7.478.536,83          |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES                                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                  |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11                               | 1.663.170,90          | 1.712.500,00          | 1.624.500,00          |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP                     | 3.669.215,98          | 1.650.473,93          | 1.658.443,98          |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                      | 8.971.480,00          | 11.744.002,56         | 11.501.794,19         |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                       | 535.595,94            | 19.504.428,89         | 19.619.800,26         |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO                   | 1.214.576,21          | 417.708,13            | 481.468,96            |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA                                         | 1.797.918,39          | 19.726.948,07         | 19.883.394,39         |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES                                    | 1.510.123,08          | 2.824.058,06          | 2.851.352,71          |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP                          | 11.366.533,79         | 8.830.229,37          | 8.912.296,88          |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | 7.104.683,66          | 51.146.285,89         | 41.455.842,59         |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                             | 11.317.524,84         | 48.434.450,79         | 38.774.874,61         |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                                                  | 48.113.243,58         | 3.907.180,93          | 3.894.031,32          |
| BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES                                              | 5.933.732,71          | 1.713.907,71          | 1.698.468,62          |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                            | 21.000.357,90         | 10.751.127,85         | 10.525.951,20         |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES | 1.706.000,00          | 5.560.659,46          | 5.239.927,82          |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                 | 3.180.930,68          | 1.811.641,14          | 1.709.339,49          |
| GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES                     | 2.730.829,83          | 2.286.222,90          | 2.103.623,00          |
| OCCAM FIC AÇÕES                                                            | 2.579.597,45          | 2.908.927,76          | 2.939.416,15          |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                   | 5.828.535,46          | 17.198.617,62         | 15.974.622,34         |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES                            | 7.352.069,95          | 6.016.984,61          | 7.701.403,07          |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | 1.824.211,38          | 1.620.990,49          | 1.531.569,04          |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                                                 | 26.320,42             | 1.818.020,03          | 1.771.675,80          |
|                                                                            | <b>352.091.926,14</b> | <b>347.526.509,59</b> | <b>350.797.335,36</b> |



## Movimentações de fevereiro/2022

| Produto / Fundo                                               | Benchmark         | Data de Movimentação | Movimento R\$  | Benchmark         | Movimento R\$ Final |
|---------------------------------------------------------------|-------------------|----------------------|----------------|-------------------|---------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                              | TÍTULOS PÚBLICOS  | 08/02/2022           | 10.002.651,43  | TÍTULOS PÚBLICOS  | 10.455.695,94       |
| TÍTULOS PÚBLICOS                                              | TÍTULOS PÚBLICOS  | 15/02/2022           | -74.919,22     | FUNDO IMOBILIÁRIO | -12.750,00          |
| TÍTULOS PÚBLICOS                                              | TÍTULOS PÚBLICOS  | 15/02/2022           | -273.764,96    | GESTÃO DURATION   | -30.000.000,00      |
| TÍTULOS PÚBLICOS                                              | TÍTULOS PÚBLICOS  | 22/02/2022           | 801.728,69     | AÇÕES - LIVRES    | 1.700.000,00        |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11                  | FUNDO IMOBILIÁRIO | 10/02/2022           | -12.750,00     | IMA-B 5+          | -169.124,01         |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | GESTÃO DURATION   | 03/02/2022           | -10.000.000,00 | IMA-B             | -841.403,04         |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | GESTÃO DURATION   | 03/02/2022           | -10.000.000,00 | IRF-M 1           | -21.871,27          |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES               | AÇÕES - LIVRES    | 07/02/2022           | 1.700.000,00   | CDI               | 1.013.549,15        |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | IMA-B 5+          | 16/02/2022           | -169.124,01    |                   |                     |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | IMA-B             | 16/02/2022           | -245.029,77    |                   |                     |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA            | IMA-B             | 16/02/2022           | -237.044,32    |                   |                     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | IMA-B             | 15/02/2022           | -15.807,56     |                   |                     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | IMA-B             | 15/02/2022           | -197.563,23    |                   |                     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | IMA-B             | 15/02/2022           | -145.958,16    |                   |                     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | GESTÃO DURATION   | 08/02/2022           | -10.000.000,00 |                   |                     |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                    | IRF-M 1           | 04/02/2022           | -4.709,83      |                   |                     |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                    | IRF-M 1           | 04/02/2022           | -17.161,44     |                   |                     |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI               | CDI               | 09/02/2022           | 1.459.310,33   |                   |                     |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI               | CDI               | 24/02/2022           | -99.017,10     |                   |                     |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI               | CDI               | 24/02/2022           | -408.812,74    |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 03/02/2022           | 36.404,23      |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 04/02/2022           | -3.605,52      |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 04/02/2022           | -21.871,27     |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 08/02/2022           | 21.871,27      |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 08/02/2022           | -3.711,12      |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 08/02/2022           | -13.586,10     |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 08/02/2022           | -21.616,61     |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 08/02/2022           | -171,34        |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 09/02/2022           | -2.641,05      |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 11/02/2022           | 344,43         |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 11/02/2022           | 2057,53        |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 15/02/2022           | -26.606,36     |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 15/02/2022           | -3.822,29      |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 15/02/2022           | -276.532,48    |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 18/02/2022           | 11746,87       |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 21/02/2022           | 2118,08        |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 23/02/2022           | 101.505,84     |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 24/02/2022           | 167.527,75     |                   |                     |
| BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO      | CDI               | 24/02/2022           | 92.656,80      |                   |                     |

## Histórico de Movimentações Acumulado



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.

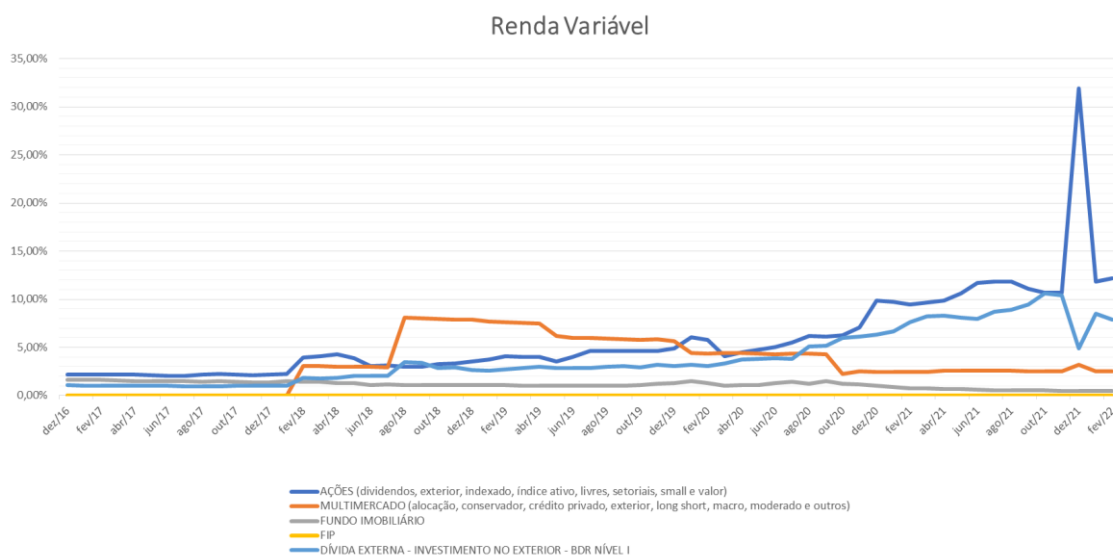


## CRÉDITO & MERCADO

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. Já no segundo semestre, em dezembro, os fundos de investimentos classificados como gestão *duration* tiveram uma queda significativa, em favor do aumento dos classificados como IMA.



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.

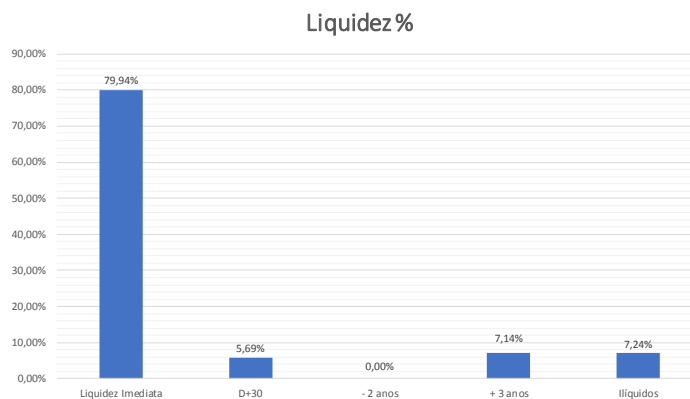


## CRÉDITO & MERCADO

### Liquidez

A carteira de investimentos possui liquidez imediata de 85,62% para auxílio no cumprimento das obrigações do RPPS.

| Disponibilidade   | Saldo                 | %      |
|-------------------|-----------------------|--------|
| Liquidez Imediata | 280.414.560,62        | 79,94% |
| D+30              | 19.953.659,50         | 5,69%  |
| - 2 anos          | -                     | 0,00%  |
| + 3 anos          | 25.045.804,07         | 7,14%  |
| Ilíquidos         | 25.383.311,17         | 7,24%  |
|                   | <b>350.797.335,36</b> |        |



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.

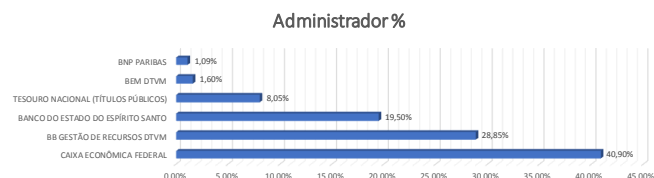


## ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

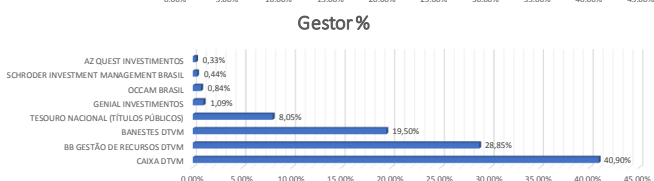
### Instituições Financeiras

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

| Administrador                       | Valor          | % s/ Carteira |
|-------------------------------------|----------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL             | 143.492.182,33 | 40,90%        |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM          | 101.217.706,69 | 28,85%        |
| BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO   | 68.420.196,16  | 19,50%        |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS) | 28.225.049,28  | 8,05%         |
| BEM DTVM                            | 5.629.238,41   | 1,60%         |
| BNP PARIBAS                         | 3.812.962,49   | 1,09%         |
| <b>350.797.335,36</b>               |                |               |



| Gestor                                | Valor          | % s/ Carteira |
|---------------------------------------|----------------|---------------|
| CAIXA DTVM                            | 143.492.182,33 | 40,90%        |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM            | 101.217.706,69 | 28,85%        |
| BANESTES DTVM                         | 68.420.196,16  | 19,50%        |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)   | 28.225.049,28  | 8,05%         |
| GENIAL INVESTIMENTOS                  | 3.812.962,49   | 1,09%         |
| OCCAM BRASIL                          | 2.939.416,15   | 0,84%         |
| SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL | 1.531.569,04   | 0,44%         |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS                | 1.158.253,22   | 0,33%         |
| <b>350.797.335,36</b>                 |                |               |



### 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<br>3.922/10, Art. 15º | Patrimonial | Fiscal | Comercial | Jurídica |
|----------------------------------------------------------|-----------------------------------|-------------|--------|-----------|----------|
| AZ QUEST INVESTIMENTOS                                   | ✗                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO                        | ✓                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| BANESTES DTVM                                            | ✓                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM                               | ✓                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| BEM DTVM                                                 | ✓                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| BNP PARIBAS                                              | ✓                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A | ✗                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| CAIXA DTVM                                               | ✗                                 | ✓           | ✓      | ✓         | ✓        |
| 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\$ 189.307.422,05.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (82,56%) e por Operação compromissada (17,44%), 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 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\$ 273.789.264,47.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por Operação compromissada (70,63%) e Títulos Públicos Federais (29,37%), 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.



## CRÉDITO & MERCADO

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.



## CRÉDITO & MERCADO

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.398.251.592,64.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (84,94%) e Operação compromissada (15,06%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

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

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

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



BB 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\$ 518.702.341,68.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (99,83%) e por Operação compromissada (0,15%) que representam o montante de 99,99% 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 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

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



BB 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\$ 580.932.851,15.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (99,79%) e Operação compromissada (0,20%) que representam o montante de 99,99% 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.



## CRÉDITO & MERCADO

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

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



BB 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\$ 452.248.894,97.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (99,77%) e por Operação compromissada (0,24%) que representam o montante de 100% 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 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 452.248.894,97.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (99,77%) e operações compromissadas em título públicos (0,24%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 26 de agosto de 2016, informando a adequação do Tipo ANBIMA do FUNDO: De: Renda Fixa Indexados, Para: Renda Fixa Duração Livre Soberano. A Política de Investimento do FUNDO permanece inalterada, sendo que tal adequação tem como objetivo melhor refletir as suas características, de acordo com a classificação ANBIMA de fundos.

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

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



CAIXA BRASIL 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\$ 1.676.536.603,63.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (99,65%) e operações compromissadas em título públicos (0,36%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 26 de agosto de 2016, informando a adequação do Tipo ANBIMA do FUNDO: De: Renda Fixa Indexados, Para: Renda Fixa Duração Livre Soberano.

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

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



CAIXA BRASIL 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\$ 199.033.290,21.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por outros (99,38%) e operações compromissadas em título públicos (0,62%), que representam o montante de 100% 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.

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



CAIXA BRASIL 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\$ 10.665.837.627,38.

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

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 10.666.768.766,65.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, por títulos públicos federais (76,99%) e operações compromissadas em títulos públicos (23,02%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 07 de dezembro de 2021, foi deliberado e aprovado (i) Alteração do tipo de tratamento fiscal da carteira do FUNDO, que será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias (Longo Prazo). (ii) Se



## CRÉDITO & MERCADO

aprovado o item (i) acima, conseqüentemente, alteração da razão social do FUNDO, com a inclusão na sua denominação do sufixo “Longo Prazo”.



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\$ 11.612.568.005,11.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (96,25%) e operações compromissadas (3,75%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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



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

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

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

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\$ 5.808.584.551,28.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas em título públicos (51,13%) e títulos públicos federais (48,86%), que representam o montante de 99,98% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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



CAIXA BRASIL IRF-M 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\$ 962.262.156,33.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (96,65%) e operações compromissadas em título públicos (3,36%), 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 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

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



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 rentabilidades 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\$ 140.645.511,93.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundos, sendo 84,87% do BANESTES LIQUIDEZ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26); 9,98% do fundo BANESTES INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA (CNPJ: 05.357.507/0001-10); e 5,14% 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.



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 2.907.017.295,14.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Operações Compromissadas (47,91%), Títulos Públicos Federais (28,57%), Debêntures (16,92%), Títulos Privados (3,38%), cotas de fundos de investimento (2,01%), sendo 0,54% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,39% do fundo BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (CNPJ: 35.818.950/0001-02); 0,35% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I (CNPJ: 33.534.867/0001-86); 0,33% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CLIENTES BRF (CNPJ: 31.547.712/0001-59); 0,13% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CREDZ (CNPJ: 24.761.946/0001-39); 0,19% do FUNDO DE



INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS X (CNPJ: 32.222.848/0001-51); 0,03% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS IX (CNPJ: 26.287.908/0001-11); 0,02% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62); e 0,01% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34), e ações (1,21%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

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),



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 201.878.031,30.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (61,62%), Operações Compromissadas (27,73%) e Debêntures (10,46%), cotas de fundos de investimento (2,19%), sendo 1,43% FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,61% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34); 0,14% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62), e derivativos (0,01%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 273.789.264,47.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas (70,63%) e títulos públicos federais (29,37%), que representam o montante de 100% 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.

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\$ 936.227.822,67.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 90,54% 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% 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% 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% 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\$ 2.907.017.295,14.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Operações Compromissadas (47,91%), Títulos Públicos Federais (28,57%), Debêntures (16,92%), Títulos Privados (3,38%), cotas de fundos de investimento (2,01%), sendo 0,54% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,39% do fundo BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (CNPJ: 35.818.950/0001-02); 0,35% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I (CNPJ: 33.534.867/0001-86); 0,33% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CLIENTES BRF (CNPJ: 31.547.712/0001-59); 0,13% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CREDZ (CNPJ: 24.761.946/0001-39); 0,19% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS X (CNPJ: 32.222.848/0001-51); 0,03% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS IX (CNPJ: 26.287.908/0001-11); 0,02% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62); e 0,01% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS



## CRÉDITO & MERCADO

CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34), e ações (1,21%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

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.



## CRÉDITO & MERCADO

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 última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.159.933.633,04.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo (99,98%), sendo 55,73% do BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.046.645/0001-81), 24,48% do BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.442.078/0001-05), 14,86% do BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 07.111.384/0001-69) e 4,96% do BB TOP RENDA FIXA IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 31.964.929/0001-64), que serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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



## CRÉDITO & MERCADO

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 19.868.823.260,47.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (55,75%) e operações compromissadas em título públicos (44,24%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

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

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

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



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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 6.297.272.158,07.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (88,95%), operações compromissadas em título públicos (11,04%) e outros (0,01%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

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

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

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



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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.398.251.592,64.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Federais (84,94%) e Operação compromissada (15,06%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

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

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

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

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.616.443.518,55.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por operações compromissadas em título públicos (87,28%) e títulos públicos federais (12,71%), que representam o montante de 99,99% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 7.639.104.845,31.

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

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

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

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



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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 9.897.711.210,36.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos (86,46%) e Operações Compromissadas (13,25%), que representam o montante de 99,71% do patrimônio do fundo.

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

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 2.339.591.507,81.

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.

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



- **FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER 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\$ 2.604.913.442,74.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (89,69%), títulos privados (4,29%), debêntures (3,75%) e operações compromissadas (2,25%), que representam o montante de 99,98% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 614.226.993,42.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (90,07%), debêntures (8,03%), títulos privados (1,19%), e operações compromissadas em título públicos (0,70%), que representam o montante de 99,99% 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



## CRÉDITO & MERCADO

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.



AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES (CNPJ: 11.392.165/0001-72)

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

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

O fundo é administrado pela BEM – Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA. (CNPJ: 00.066.670/0001-00), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552, de 07 de dezembro de 2019, e gerido pela AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA. (CNPJ: 04.506.394/0001-05), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 6435, de 20 de julho de 2001.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciada 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 buscar retorno aos seus cotistas por meio da aplicação dos recursos dos seus Cotistas de, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seu patrimônio líquido em cotas do AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES, inscrito no CNPJ sob o n.º 11.403.884/0001-41.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.428.707.503,72.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo de investimentos (99,94%), do AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FI AÇÕES (CNPJ: 11.403.884/0001-41) e operações compromissadas em títulos públicos (0,13%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Em 05 de agosto de 2019 foi publicado Fato Relevante, onde a administradora, seguindo orientação da gestora da carteira do Fundo, nos termos do Artigo 19 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, informa que, suspenderá novas aplicações no Fundo, por prazo indeterminado, no fechamento de 08 de agosto de 2019.



Foi localizado Fato Relevante, publicado em 04 de janeiro de 2021, informando que (i) reabrirá o Fundo a partir desta data 04 de janeiro de 2021, inclusive para novas aplicações, sendo que a reabertura se aplica indistintamente a novos investidores e cotistas atuais; e (ii) que o Fundo fechará para novas captações ao final do dia útil subsequente a data em que o seu Patrimônio Líquido atingir R\$ 1.800.000.000,00.

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

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 3 de junho de 2019 deliberou, a partir do fechamento de 14 de junho de 2019, a transferência da administração do Fundo, a fim de alterar a Administradora do Fundo de BNY Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. para BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., a substituição do atual prestador dos serviços de controladoria, custódia e tesouraria do Fundo para o Banco Bradesco S.A. e a partir de 17 de junho de 2019 e a alteração do regulamento do Fundo, nos capítulos “Do Público Alvo”, “Do Objetivo e da Política de Investimentos”, “Das Taxas e dos Encargos”, a fim de excluir a taxa de custódia do Fundo, “Da Emissão e do Resgate de Cotas” e a alteração integral do regulamento do Fundo aos padrões da nova administradora.

O Instrumento Particular de Alteração realizado em 7 de maio de 2019 deliberou, a partir de 27 de maio de 2019, a alteração do regulamento do Fundo, no capítulo “Da Emissão e do Resgate de Cotas”.

A Assembleia Geral de Cotista realizada em 3 de setembro de 2018 deliberou, a partir de 10 de outubro de 2018, a alteração do regulamento do Fundo, no capítulo “Do Objetivo e da Política de Investimento”

- AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.403.884/0001-41)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de cotas de fundos de investimento 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), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552, de 07 de dezembro de 2019, e gerido pela AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA. (CNPJ: 04.506.394/0001-05), credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 6435, de 20 de julho de 2001.



## CRÉDITO & MERCADO

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), credenciada 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 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. O fundo poderá investir em ações de maior liquidez ou capitalização de mercado, desde que não estejam incluídas entre as dez maiores participações do IBRX – Índice Brasil, com exceção da empresa SUZANO (SUZB3) ou empresas derivadas de fusão ou aquisição da mesma.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.012.836.432,27.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (80,29%), outros (15,07%), operações compromissadas (2,60%), títulos federais (1,39%), que representam o montante de 99,35% do patrimônio do fundo.

Não há publicação de fatos relevantes.

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 9 de maio de 2019 deliberou, a partir do fechamento de 17 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 20 de maio de 2019, a alteração do regulamento do Fundo, nos capítulos “Da Administração e dos Prestadores de Serviços”, 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”, “Da Emissão e do Resgate de Cotas” e “Das Disposições Gerais”.



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 159.417.690,23.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99,98% das cotas de fundo de investimentos, sendo 99,27% do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.977.794/0001-64) e 0,72% do BANESTES LIQUIDEZ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI (CNPJ: 20.230.719/0001-26), 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\$



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 1.853.554.335,79.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% pelas cotas do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FUNDO DE



## CRÉDITO & MERCADO

INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 17.009.959/0001-90) e operações compromissadas (0,21%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 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\$ 2.907.017.295,14.



## CRÉDITO & MERCADO

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Operações Compromissadas (47,91%), Títulos Públicos Federais (28,57%), Debêntures (16,92%), Títulos Privados (3,38%), cotas de fundos de investimento (2,01%), sendo 0,54% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,39% do fundo BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (CNPJ: 35.818.950/0001-02); 0,35% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I (CNPJ: 33.534.867/0001-86); 0,33% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CLIENTES BRF (CNPJ: 31.547.712/0001-59); 0,13% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CREDZ (CNPJ: 24.761.946/0001-39); 0,19% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS X (CNPJ: 32.222.848/0001-51); 0,03% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS IX (CNPJ: 26.287.908/0001-11); 0,02% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62); e 0,01% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34), e ações (1,21%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

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.



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 15.123.966,27.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% por cotas de fundo de investimento, sendo 99,10% no BTG PACTUAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 09.290.813/0001-38) e 1,18% 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\$ 68.193.768,47.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% por cotas de fundo de investimento, do BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 18.969.955/0001-17), e operações compromissadas (0,13%), que representam o montante de 100% 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.

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 2.907.017.295,14.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Operações Compromissadas (47,91%), Títulos Públicos Federais (28,57%), Debêntures (16,92%), Títulos Privados (3,38%), cotas de fundos de investimento (2,01%), sendo 0,54% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LIGHT (CNPJ: 29.665.468/0001-87); 0,39% do fundo BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (CNPJ: 35.818.950/0001-02); 0,35% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I (CNPJ: 33.534.867/0001-86); 0,33% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CLIENTES BRF (CNPJ: 31.547.712/0001-59); 0,13% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CREDZ (CNPJ: 24.761.946/0001-39); 0,19% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS X (CNPJ: 32.222.848/0001-51); 0,03% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS IX (CNPJ: 26.287.908/0001-11); 0,02% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS ANGÁ SABEMI CONSIGNADOS VIII (CNPJ: 27.614.527/0001-62); e 0,01% do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS VERDECARD (CNPJ: 26.722.650/0001-34), e ações (1,21%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

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\$ 470.291.721,53.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundo de investimentos (72,12%), sendo 13,67% do BB TOP AÇÕES SETOR FINANCEIRO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 08.973.959/0001-15); 9,69% do BB AÇÕES PETROBRAS I FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 30.518.554/0001-46); 9,39% do BB AÇÕES VALE FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 04.881.682/0001-40); 7,38% do BB ETF IBOVESPA FUNDO DE INDICE (CNPJ: 34.606.480/0001-50); 06,65% do BB TOP AÇÕES SETORIAL CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 08.973.939/0001-44); 4,46% do BB TOP AÇÕES EXPORTAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.149.221/0001-40); 4,32% do BB TOP AÇÕES TOTAL RETURN FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 18.324.946/0001-79); 3,03% do BB TOP AÇÕES SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.100.234/0001-24); 2,49% do BB TOP AÇÕES INFRAESTRUTURA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.451.187/0001-66); 2,45% do BB AÇÕES PETROBRAS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 03.920.413/0001-82); 2,22% do BB AÇÕES ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 02.020.528/0001-58); 2,14% do BB TOP AÇÕES AGRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 40.054.367/0001-02); 1,94% do BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 01.578.474/0001-88); 0,97% do BB TOP AÇÕES DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.100.230/0001-46); 0,94% do BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 36.178.569/0001-99); 0,54% do BB TOP AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 09.635.615/0001-69); 0,33% 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 (10,98%), operações



## CRÉDITO & MERCADO

compromissadas (10,05%) e derivativos (0,17%), que representam o montante de 93,32% do patrimônio do fundo.

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 TOP AÇÕES SETOR FINANCEIRO FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 08.973.959/0001-15)

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 saída, cobradas pelo fundo.

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

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ações de empresas dos setores de intermediários financeiros, serviços financeiros diversos, previdência e seguros.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 289.697.308,29.



## CRÉDITO & MERCADO

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (98,81%), operações compromissadas (0,40%) e derivativos (0,01%), representando 99,22% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes.

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 Cotistas, realizada em 08 de maio de 2020, foram aprovados os seguintes itens: (i) alteração do objetivo do fundo, no artigo 2º do regulamento; (ii) alteração da destinação do fundo, no artigo 3º do regulamento; (iii) alteração do quadro de composição da carteira, no artigo 11º do regulamento; (iv) exclusão do parágrafo 5º do artigo 11 do regulamento; (v) inclusão do parágrafo 5º no artigo 11 do Regulamento, incluindo a possibilidade do fundo investir até 20% do patrimônio líquido em ativos financeiros negociados no exterior; (vi) inclusão dos parágrafos 6º, 7º e 8º no artigo 11 do regulamento e (vii) alteração e reordenamento dos fatores de risco do fundo do artigo 14 do regulamento. Tais deliberações entraram em vigor em 08 de maio de 2020.

- BB TOP AÇÕES TOTAL RETURN FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 18.324.946/0001-79)

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 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 como objetivo compor uma carteira de ações de empresas brasileiras e estrangeiras cujas ações sejam negociadas na Bolsa brasileira via BDR pertencentes a diversos setores da economia, selecionadas com base em metodologias qualitativas, de forma a buscar as melhores oportunidades no mercado de bolsa nacional, sem obrigatoriedade de seguir um determinado índice de mercado.



## CRÉDITO & MERCADO

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.295.377.549,76.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (94,71%), cotas de fundos de investimentos (2,25%), do BB ETF IBOVESPA FUNDO DE INDICE (CNPJ: 34.606.480/0001-50), operações compromissadas (0,38%), representando o montante de 97,97% do patrimônio do fundo.

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

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

Em Assembleia Geral Extraordinária de Cotista, realizada em 20 de maio de 2021, foram aprovadas as seguintes alterações: (i) alteração da política de investimento incluindo a possibilidade de aplicação em Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I até o limite de 20% e a possibilidade de o fundo aplicar até 20% do seu Patrimônio Líquido em ativos financeiros no exterior; (ii) alteração e reordenamento dos fatores de risco. Tais deliberações entraram em vigor em 21 de maio de 2021.

- BB TOP AÇÕES SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.100.234/0001-24)

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

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

O fundo tem por objetivo acompanhar a variação da rentabilidade média das ações negociadas em bolsas de valores emitidas por empresas com relativamente baixa e média capitalização de mercado.



Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 463.212.187,73.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (94,71%), cotas de fundo de investimentos (2,25%), do ETF TRÍGONO TEVA AÇÕES MICRO CAP / SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 43.140.303/0001-12) e operação compromissada (0,38%), representando 97,22% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes.

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

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 12 de fevereiro de 2020, com vigência para o dia 13/02/2020 foram deliberadas Inclusões e alterações conforma abaixo: i. Inclusão do parágrafo único do artigo 3º do Regulamento, dispondo que a carteira do FUNDO deverá observar no que couber as Resoluções CMN nº 3.922/10 e 4.661/18; ii. Inclusão dos parágrafos 3º e 4º do artigo 12 do Regulamento para adequar o regulamento às Resoluções CMN 4.661/18 e 3.922/10, relativas às vedações impostas por essas normas; Alterações: iii. Alteração do percentual de limites mínimos e máximos no item 1 do Quadro de Composição da Carteira no artigo 12 do Regulamento, conforme abaixo: - Mínimo 85% e Máximo 100% em ações de empresas consideradas como de alto potencial de valorização negociadas no mercado à vista de Bolsa de Valores ou em mercado de balcão organizado que não estejam enquadradas entre as vinte e cinco maiores participações do IbrX — índice Brasil; iv. Alteração do percentual de limites mínimos e máximos dos itens 2,3,4,5 e 6 do Quadro de Composição da Carteira no artigo 12 do Regulamento, conforme abaixo: - Mínimo 0% e Máximo 15% em 2) Ações de maior liquidez no mercado, desde que não estejam incluídas entre 10 maiores participações do IbrX — índice Brasil 3) Títulos Públicos Federais 4) Cotas de fundos de investimento 5) Operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais 6) Brazilian Depositary Receipts — BDR classificados como nível II e III, de acordo com o artigo 3º, parágrafo 1º, incisos II e III da Instrução CVM nº332, de 04 de abril de 2000; v. Alteração do parágrafo 2º do artigo 12 do Regulamento para adequar o regulamento às Resoluções CMN 4.661/18 e 3.922/10, relativas às vedações impostas por essas normas.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 20 de maio de 2021, com vigência para o dia 21/05/2021 foram deliberadas alterações conforma abaixo: i. Artigo 12 – Alteração da Política de Investimento: a) Alteração do item 7, no quadro de composição da carteira, do nível máximo de aplicação em BDR classificados como níveis II e III, para 100%; b) Inclusão do item 8, no quadro da composição da carteira, da possibilidade de aplicação em BDR classificados como nível I até o limite de 20%; c) Inclusão do parágrafo 6º, para inclusão da possibilidade de o fundo aplicar até 20% do



seu Patrimônio Líquido em ativos financeiros no exterior; ii. Artigo 15 – Alteração e reordenamento dos fatores de risco

- BB TOP AÇÕES DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 05.100.230/0001-46)

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 708.127.828,03.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (89,56%), Brazilian Depositary Receipts (3,57%), operações compromissadas (3,52%), Títulos Públicos Federais (0,06%) e derivativos (0,05%), que representam o montante de 96,65% do patrimônio.

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

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

Em Assembleia Geral Extraordinária de Cotistas, realizada em 23 de abril de 2021, foram deliberadas: (i) Artigo 3º - Inclusão do parágrafo único, informando que o fundo deverá observar, no que couber, as Resoluções CMN 3922/10 e 4661/18; (ii) Artigo 12 – Alteração da Política de Investimento, conforme abaixo: a) Inclusão do item 6, no



## CRÉDITO & MERCADO

quadro da composição da carteira, da possibilidade de aplicação em BDR classificados como nível I até o limite de 20%; b) Alteração do parágrafo 5º, para atualização das vedações dispostas nas Resoluções 4661/018 e 3922/10; c) Inclusão do parágrafo 8º, para inclusão da possibilidade de o fundo aplicar até 20% do seu Patrimônio Líquido em ativos financeiros no exterior; DocuSign Envelope ID: 1C9413FA-1132-475B-800A-4D1DC2897785 BB TOP AÇÕES DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ No. 05.100.230/0001-46 (Administrado pela BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. - BB DTVM) NOTAS EXPLICATIVAS ÀS DEMONSTRAÇÕES CONTÁBEIS REFERENTES AOS EXERCÍCIOS FINDOS EM 30 DE SETEMBRO DE 2021 E 2020 (Em milhares de reais, exceto o valor unitário das cotas) 18 - Alteração e reordenamento dos fatores de risco. Tais deliberações entraram em vigor em 29 de abril de 2021.



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 1.491.112.952,73.

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

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

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

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



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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.819.809.889,83.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (69,10%), cotas de fundos de investimento (10,50%), sendo 6,01% do ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 10.406.511/0001-61), 3,57% do BB ETF IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 34.606.480/0001-50) e 0,91% do IT NOW IFNC FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ: 11.961.094/0001-81), operação compromissada (12,30%) e derivativos (0,26%), representando 92,16% do patrimônio do fundo.

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

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

Em 28 de maio de 2021, em Assembleia Geral Extraordinária foram deliberados: i) Artigo 3º - Inclusão do parágrafo único, informando que o fundo deverá observar, no que couber, as Resoluções CMN 3922/10 e 4661/18; ii) Artigo 11 – Alteração da Política de investimento, conforme abaixo: a) Inclusão do item 6, no quadro da composição da carteira, da possibilidade de aplicação em BDR classificados como nível



## CRÉDITO & MERCADO

1 até o limite de 20%; b) Inclusão do parágrafo 5º, para inclusão da possibilidade de o fundo aplicar até 20% do seu Patrimônio Líquido em ativos financeiros no exterior; c) Inclusão do parágrafo 6º, referente às vedações ao fundo. iii) Artigo 14 – Alteração e reordenamento dos fatores de risco. Tais deliberações entraram em vigor em 31 de maio de 2021.



## CRÉDITO & MERCADO

BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES (CNPJ: 09.005.805/0001-00)

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 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 como objetivo aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento (FIs) direcionados para assumir posições em ações de empresas brasileiras e estrangeiras, cujas ações sejam negociadas na bolsa brasileira via BDR pertencentes a diversos setores da economia, selecionadas com base em metodologias qualitativas, de forma a buscar as melhores oportunidades no mercado de bolsa nacional, sem obrigatoriedade de seguir um determinado índice de mercado.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.282.531.872,11.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por cotas de fundos de investimentos (99,33%), do BB TOP AÇÕES TOTAL RETURN FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 18.324.946/0001-79), que será apresentado adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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 TOTAL RETURN FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 18.324.946/0001-79)



## CRÉDITO & MERCADO

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 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 como objetivo compor uma carteira de ações de empresas brasileiras e estrangeiras cujas ações sejam negociadas na Bolsa brasileira via BDR pertencentes a diversos setores da economia, selecionadas com base em metodologias qualitativas, de forma a buscar as melhores oportunidades no mercado de bolsa nacional, sem obrigatoriedade de seguir um determinado índice de mercado.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.295.377.549,76.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (88,26%), cotas de fundos de investimentos (4,27%), do BB ETF IBOVESPA FUNDO DE INDICE (CNPJ: 34.606.480/0001-50), operações compromissadas (2,60%), títulos federais (0,81%) e derivativos (0,04%), representando o montante de 95,97% do patrimônio do fundo.

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

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

Em Assembleia Geral Extraordinária de Cotista, realizada em 20 de maio de 2021, foram aprovadas as seguintes alterações: (i) alteração da política de investimento incluindo a possibilidade de aplicação em Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I DocuSign até o limite de 20% e a possibilidade de o fundo aplicar até 20%



## CRÉDITO & MERCADO

do seu Patrimônio Líquido em ativos financeiros no exterior; (ii) alteração e reordenamento dos fatores de risco. Tais deliberações entraram em vigor em 21 de maio de 2021.



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\$ 519.470.760,94.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por 100% de cotas do Fundo de Investimento, sendo 99,42% de cotas do AÇÕES CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO (CNPJ: 30.036.209/0001-76) e 0,60% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), que serão apresentados a seguir.

Não há fatos relevantes publicados.

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

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



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

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 729.747.034,42.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (99,01%) e fundos de investimento (0,63%), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO, representando 99,64% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.060.271.994,57.



A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (99,33%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,19%), representando 99,52% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

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

Conforme Assembleia Geral de Cotista realizada em 16 de novembro de 2020 foram deliberadas as seguintes alterações: I. Inclusão da classificação do Fundo, de acordo com o padrão utilizado pela Administradora. II. Alteração da política de investimento do Fundo, de forma a limitar a exposição da carteira do Fundo apenas ao risco de taxa de juros pós-fixadas. III. Artigo 6º: adequação no objetivo do fundo, com a exclusão da obrigatoriedade dos títulos públicos federais que compõem a carteira do Fundo sejam indexados a taxas de juros prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI); IV.

Inclusão da previsão de que as deliberações da assembleia geral podem ser adotadas mediante processo de consulta formal, sem necessidade de reunião de Cotista, conforme artigo 71 da ICVM 555.

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



CAIXA EXPERT VINCI 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.

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\$ 985.463.082,71.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% das cotas de fundo de investimentos, sendo 99,73% do CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 15.154.458/0001-72) e 0,27% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), que serão apresentados adequadamente a seguir.



## CRÉDITO & MERCADO

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 dele.

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

Conforme Assembleia Geral de Cotistas realizada no dia 21 de outubro de 2020 foi aprovado: (i) Ajuste redacional no público alvo, de acordo com o padrão utilizado pela Administradora; (ii) Alteração da Política de Investimento do Fundo, com a exclusão à menção do índice DI, referente aos Fundos de Investimento da classe Renda Fixa, na composição da carteira do Fundo Investido (Caixa Vinci Valor Dividendos Fundo de Investimento em Ações).

A Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 18 de outubro de 2021, deliberou sobre as seguintes matérias: (i) Transferência dos serviços de gestão da carteira do FUNDO, atualmente exercida pela VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA ("GESTORA") pelos serviços de gestão da CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A ("NOVA GESTORA"), e; (ii) Aprovado o item (i), alterar o regulamento do FUNDO de modo a adequar o documento, com o objetivo de viabilizar a transferência da atual gestão da carteira do FUNDO, bem como outras adequações a saber: • Alteração na razão social do FUNDO; • Exclusão das menções da atual GESTORA, seus meios de contato e endereço, para a inserção dos dados da NOVA GESTORA; • Atualização do nome da B3 – Brasil, Bolsa, Balcão em todo o regulamento, e; • Em função da aprovação do item (i) da ordem do dia, adequação do Artigo 33 do Regulamento do FUNDO, por meio da exclusão do parágrafo único, de modo a garantir que a taxa de administração engloba a taxa do fundo investido, não havendo, sob nenhuma hipótese, alteração no valor da taxa de administração do FUNDO.

- 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.



## CRÉDITO & MERCADO

O fundo tem por objetivo de investimento buscar proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas 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\$ 982.856.679,21.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (98,34%) e operações compromissadas (0,71%), que representam o montante de 99,05% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Em Assembleia 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.

Em Assembleia Geral de Cotista realizada em 18 de outubro de 2021, foi aprovada a (i) Inclusão da cobrança de taxa de administração do Fundo, no valor de 0,904% (novecentos e quatro milésimos por cento) ao ano e compreenderá a taxa de administração dos fundos investidos, proporcionalmente ao percentual investido em cada fundo de investimento; e (ii) alteração do artigo 2º com a adequação no público alvo do Fundo, com a exclusão da menção aos fundos geridos pela Gestora.

- CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LP (CNPJ: 05.164.353/0001-40)

Trata-se de um fundo constituído como condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

A administração e Gestão da carteira do Fundo é exercida pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), credenciada como Administradora e Gestora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

A custódia, tesouraria e controladoria dos ativos financeiros do Fundo também é realizada pela Caixa Econômica Federal, credenciada como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 6.661, de 10 de janeiro de 2002.



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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.060.271.994,57.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (99,33%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,19%), representando 99,52% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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



CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES9 (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\$ 739.508.223,24.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% por cotas de fundo de investimentos, sendo 99,76% do CAIXA VINCI VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 14.507.681/0001-93) e 0,29% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), 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 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

A Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 18 de outubro de 2021, deliberou sobre as seguintes matérias: (i) Transferência dos serviços de gestão da carteira do FUNDO, atualmente exercida pela VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA ("GESTORA") pelos serviços de gestão da CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A ("NOVA GESTORA"), e; (ii) Aprovado o item (i), alterar o regulamento do FUNDO de modo a adequar o documento, com o objetivo de viabilizar a transferência da atual gestão da carteira do FUNDO, bem como outras adequações a saber: • Alteração na razão social do FUNDO; • Exclusão das menções da atual GESTORA, seus meios de contato e endereço, para a inserção dos dados da NOVA



## CRÉDITO & MERCADO

GESTORA; • Atualização do nome da B3 – Brasil, Bolsa, Balcão em todo o regulamento, e; • Em função da aprovação do item (i) da ordem do dia, adequação do Artigo 33 do Regulamento do FUNDO, por meio da exclusão do parágrafo único, de modo a garantir que a taxa de administração engloba a taxa do fundo investido, não havendo, sob nenhuma hipótese, alteração no valor da taxa de administração do FUNDO.

- CAIXA VINCI VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 14.507.681/0001-93)

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 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, buscando a obtenção e maximização de ganhos de capital e a elevação da liquidez das posições formadas, através do acompanhamento e participação contínuos das atividades das companhias alvo, incentivando a adoção de práticas de governança corporativa alinhadas com as boas práticas de mercado e impulsionando seus resultados.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 737.787.983,23.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (98,63%) e operações compromissadas (0,96%), que representam o montante de 99,59% do patrimônio do fundo.

Foi localizado Fato Relevante, publicado em 12 de janeiro de 2021, informando a data da primeira integralização de cotas e consequente início de atividades do FUNDO ocorrido em 12/12/2011. A divulgação deste Fato Relevante segue os termos do Regulamento do FUNDO.

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



Em 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.

A Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 18 de outubro de 2021, deliberou sobre as seguintes matérias: (i) Inclusão da cobrança de taxa de administração do FUNDO, no valor de 0,904% (novecentos e quatro milésimos por cento) ao ano e compreenderá a taxa de administração dos fundos investidos, proporcionalmente ao percentual investido em cada fundo de investimento; e (ii) Alteração do artigo 2º, com a adequação do público-alvo do FUNDO, com a exclusão da menção aos fundos geridos pela GESTORA.

- CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LP (CNPJ: 05.164.353/0001-40)

Trata-se de um fundo constituído como condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração. Não há carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

A administração e Gestão da carteira do Fundo é exercida pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), credenciada como Administradora e Gestora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995. A custódia, tesouraria e controladoria dos ativos financeiros do Fundo também é realizada pela Caixa Econômica Federal, credenciada como Custodiante de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 6.661, de 10 de janeiro de 2002.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.060.271.994,57.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (99,33%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,19%), representando 99,52% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Conforme Assembleia Geral de Cotista realizada em 16 de novembro de 2020 foram deliberadas as seguintes alterações: I. Inclusão da classificação do Fundo, de acordo



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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 1.097.636.218,28.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta 100% por cotas de fundos de investimento, do OCCAM FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.616.482/0001-25) e operações compromissadas (0,27%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

A Assembleia Geral de Cotistas, realizada em 11 de abril de 2019, deliberou em 24 de abril de 2019: (i) a substituição do antigo administrador do fundo, BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. para BEM DTVM Ltda.; (ii) a substituição do prestador dos serviços de custódia, controladoria e tesouraria do Fundo para Banco Bradesco S.A.; (iii) substituição do prestador de serviços de distribuição, agenciamento e colocação de cotas do Fundo pelo Genial Institucional CCTVM S.A.; (iv) manutenção do atual prestador de serviços de administração de carteira (gestão) do fundo, qual seja, a



Occam Brasil Gestão de Recursos Ltda.; (v) manutenção dos prestadores de serviços de auditoria do Fundo; (vi) manutenção da denominação social do Fundo; (vii) alteração do foro do Fundo para Cidade de Deus; (viii) exclusão das menções ao BNY Mellon, seus meios de contato e endereço, para inserção da Nova Administradora; e (ix) 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 que a partir do dia 27 de maio de 2019 a adaptação do prazo de pagamento de resgate aos cotistas do Fundo, o qual foi reduzido em 01 (um) dia.

A Assembleia Geral de Cotistas, realizada em 07 de fevereiro de 2020, deliberou a partir de 13 de março de 2020 a (1) alteração do regulamento nos seguintes capítulos: (i) Da Política de Investimentos e Identificação dos Fatores de Risco; (ii) Da Administração e dos Prestadores de Serviços; (iii) Da Remuneração e Demais Despesas do Fundo; (iv) Da Emissão e do Resgate de Cotas; e (v) Das Disposições Gerais; (20 inclusão, no regulamento, dos capítulos: Da Política de Divulgação de Informações e de Resultados e da Tributação Aplicável.

Em 07 de fevereiro de 2020, a Assembleia Geral deliberou a partir de 16 de março de 2020 a (i) a alteração da Remuneração e Demais Despesas do Fundo, a fim de (a) reduzir a taxa de administração paga pelo Fundo de: 3% (três por cento) para 2% (dois por cento); (b) reduzir a taxa de administração máxima do fundo de 3,5% (três inteiros e cinco décimos por cento) para 2,5% (dois inteiros e cinco décimos por cento).

- OCCAM FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.616.482/0001-25)

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.



## CRÉDITO & MERCADO

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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.166.983.845,21.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (91,82%), outros (5,43%), operações compromissadas (2,62%) e derivativos (0,03%), que representam o montante de 99,90% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

A Assembleia Geral de 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.



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\$ 828.073.336,84.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por investimentos no exterior (98,13%) e operações compromissadas (0,57%), representando o montante de 98,70 do patrimônio total do fundo.

Foi localizado fato relevante, publicado em 18 de junho de 2021, informando o fechamento para novas aplicações do fundo BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IE FI, CNPJ: 28.578.936/0001-13 a partir do dia 25/06/2021, inclusive, e por prazo indeterminado.

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO (CNPJ: 17.431.816/0001-72)

Trata-se de um fundo de investimentos constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, é regido pelo presente regulamento e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis.

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

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

O fundo tem por objetivo aplicar os recursos dos cotistas, preponderantemente, em ativos financeiros negociados no exterior, observadas as disposições contidas no art. 98 da Instrução CVM nº 555/14.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 883.248.355,74.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por investimentos no exterior (98,35%) e operação compromissada (1,65%), representando 100% do patrimônio total do fundo.

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

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 184.161.184,80.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundos de investimentos (99%), 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.

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



## CRÉDITO & MERCADO

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.



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 266.514.218,75.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99% em 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.

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 314.493.098,59.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99,81% de cotas de fundo do SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INVESTIMENTO NO EXTERIOR (CNPJ: 37.308.317/0001-08), que será devidamente apresentado a seguir, e operações compromissadas (0,23%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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



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”.

- SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INVESTIMENTO NO EXTERIOR (CNPJ: 37.308.317/0001-08)

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

O fundo é administrado pela BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. (CNPJ: 00.066.670/0001-00), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 3.067, de 06 de setembro de 1994, e gerido pela Schroder Investment Management Brasil Ltda. (CNPJ: 92.886.662/0001-2), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório no 6.816, de 10 de maio de 2002, doravante denominada Gestora.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o BANCO BRADESCO S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente credenciado pela CVM – Comissão de Valores Mobiliários como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 1.432, de 27 de junho de 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\$ 381.445.350,57.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Investimentos no Exterior (99,85%) e operações compromissadas (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 março de 2021, onde menciona que as demonstrações



## CRÉDITO & MERCADO

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

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\$ 3.479.303.240,79.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Brazilian Depositary Receipts – BDR (98,99%) e cotas de fundos (1,09%), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00), onde será apresentado adequadamente a seguir, que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não foi encontrado Fato Relevante.

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

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 26 de outubro de 2020, foi deliberado e aprovado sobre a alteração do público alvo do fundo, com a exclusão de “pessoas físicas”, de modo a adequar o segmento prioritário estipulado, para participação do Fundo.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a



CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001-40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.

- **FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.375/0001-00)**

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

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

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em ativos financeiros, obtendo níveis de rentabilidade compatíveis aos do Depósito Interfinanceiro - DI (CETIP).

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 15.454.800.424,32.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (70,22%) e operações compromissadas (29,72%), que representam o montante de 99,93% do patrimônio do fundo.

Não foi encontrado Fato Relevante.

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

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



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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 269.526.841,72.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% em cotas de fundo de investimentos, sendo 97,48% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO (CNPJ: 11.060.913/0001-10) e 2,63% do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER TPF RENDA FIXA LONGO PRAZO (CNPJ: 05.164.353/0001-40), que serão apresentados adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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



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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 11.612.568.005,11.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (96,25%) e operações compromissadas em títulos públicos (3,75%), 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 2021, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.060.271.994,57.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (99,33%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,19%), representando 99,52% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

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

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



## CRÉDITO & MERCADO

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\$ 3.122.842.560,56.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos (59,24%), operações compromissadas lastradas em títulos públicos (36,56%) e derivativos (2,35%), representando 98,15% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

De acordo com a Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de dezembro de 2020, foram deliberadas as seguintes alterações: i. Alteração da razão social do Fundo de “Fundo de Investimento Caixa Bolsa Americana Multimercado Longo Prazo” para “Fundo de Investimento Caixa Indexa Bolsa Americana Multimercado Longo Prazo”; ii. Adequação do público alvo, de acordo com o padrão redacional utilizado pela Administradora e redução da taxa de administração que passa de 1,20% (um inteiro e vinte centésimos por cento) para 0,80% (oitenta centésimos por cento) ao ano sobre o valor do Patrimônio Líquido do Fundo.

Em Assembleia Geral Extraordinária, realizada em 8 de outubro de 2021, foi deliberado e aprovado sobre a transferência do serviço de gestão da carteira do FUNDO para a



## CRÉDITO & MERCADO

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. – CAIXA ASSET, inscrita no CNPJ/MF sob o nº. 42.040.639/0001- 40; e autorizar a ADMINISTRADORA a promover a consolidação do regulamento do FUNDO, em até 30 dias úteis após a divulgação do Resumo das deliberações, com os ajustes redacionais e a inclusão dos dados cadastrais da CAIXA ASSET.



## CRÉDITO & MERCADO

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 e prazo de duração indeterminado. Não há carência, taxas de ingresso ou saída cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado 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,

Ele é gerido pela CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A – CAIXA DTVM (CNPJ: 42.040.639/0001-40), devidamente credenciada pela CVM conforme Ato Declaratório nº 19.043, de 30 de agosto de 2021 e Co-gerido pela RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA. (CNPJ: 03.864.607/0001-08).

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 131.175.731,07.

A última carteira de investimentos do fundo disponível, referente ao mês de dezembro de 2021, é composta por 97,83% de cotas de fundo de Investimento.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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



## 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



## CRÉDITO & MERCADO

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 4.963/2021 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 segundo mês do exercício de 2022.

Permanecemos à disposição para eventuais esclarecimentos.

Atenciosamente,

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

Nahida Zahra Lakis  
Bacharelado em Direito  
CPA-10 Anbima  
Analista de Compliance

CRÉDITO E MERCADO – CONSULTORIA EM INVESTIMENTOS  
(C.N.P.J.: 11.340.009/0001-68)



## DISCLAIMER

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Esta é apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis. A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade das mesmas, e não devem ser consideradas como tais. As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos e prospectos de divulgação. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, ao risco e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários). Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM. A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 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.