



RELATÓRIO DE DILIGÊNCIA E ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO
DE ANGRA DOS REIS**

SUMÁRIO

INTRODUÇÃO	3
ANÁLISE DE CARTEIRA	4
Composição da Carteira de Investimentos	4
Casamento de Ativo e Passivo	7
Evolução Patrimonial	7
Rentabilidade	8
Controle de Risco	9
Históricos de Movimentações.....	11
Liquidez	14
ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	15
Instituições Financeiras.....	15
Análise da Situação das Instituições Financeiras	15
ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS.....	17
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP (CNPJ: 03.543.447/0001-03).....	17
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.442.078/0001-05)	19
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 11.328.882/0001-35).....	20
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 19.303.793/0001-46).....	22
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 18.598.117/0001-84)	24
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 18.598.088/0001-50)	25
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 23.215.097/0001-55)	26
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 14.386.926/0001-71)	28
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 11.060.913/0001-10).....	29
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 10.740.670/0001-06).....	30
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.588/0001-89)	31
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 28.515.874/0001-09).....	32
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 15.188.380/0001-07)	34
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA (CNPJ: 05.073.656/0001-58)	39
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 21.838.150/0001-49)	42
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 18.599.673/0001-75)	45
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP (CNPJ: 14.146.491/0001-98)	46
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR (CNPJ: 12.138.813/0001-21)	48
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES (CNPJ: 07.279.657/0001-89)	50
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES (CNPJ: 11.392.165/0001-72)	52
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 34.791.108/0001-61)	55

BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES (CNPJ: 18.270.783/0001-99).....	58
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 11.977.794/0001-64).....	59
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES (CNPJ: 09.290.813/0001-38).....	61
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES (CNPJ: 14.507.699/0001-95).....	63
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES (CNPJ: 11.182.064/0001-77).....	65
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES (CNPJ: 14.550.994/0001-24).....	67
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES (CNPJ: 34.546.979/0001-10).....	69
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES (CNPJ: 24.571.992/0001-75).....	70
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES (CNPJ: 23.731.629/0001-07).....	73
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES (CNPJ: 16.718.302/0001-30).....	76
META VALOR FI AÇÕES (CNPJ: 07.899.238/0001-40).....	79
MULTINVEST FI AÇÕES (CNPJ: 13.608.335/0001-39).....	81
OCCAM FIC AÇÕES (CNPJ: 11.628.883/0001-03).....	83
QUELUZ VALOR FI AÇÕES (CNPJ: 09.289.072/0001-75).....	86
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES (CNPJ: 11.458.144/0001-02).....	87
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO (CNPJ: 09.141.893/0001-60).....	89
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.597/0001-70).....	92
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO (CNPJ: 27.746.867/0001-47).....	93
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP (CNPJ: 35.640.811/0001-31).....	95
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP (CNPJ: 16.685.929/0001-31).....	97
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 (CNPJ: 20.716.161/0001-93).....	100
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 (CNPJ: 13.584.584/0001-31).....	101
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 (CNPJ: 13.842.683/0001-76).....	103
CONCLUSÃO.....	104
DISCLAIMER.....	106

INTRODUÇÃO

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

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

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

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

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

ANÁLISE DE CARTEIRA

Composição da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos – dezembro/2020

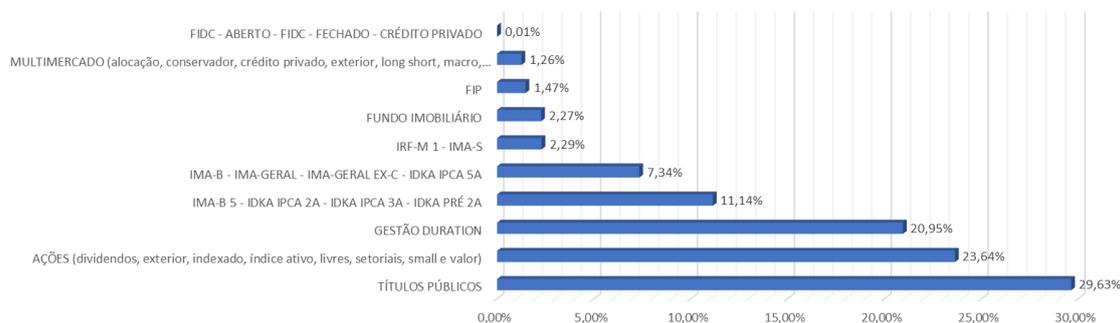
Produto / Fundo	Benchmark	Disponibilidade	Carência	Saldo	Carteira %
TÍTULOS PÚBLICOS	TÍTULOS PÚBLICOS			275.692.461,41	29,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	D+1	Não há	40.747.323,95	4,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	D+1	Não há	11.371.969,49	1,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IRF-M 1	D+0	Não há	15.495.206,02	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	D+0	15/08/2022	17.085.725,36	1,84%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	D+0	16/08/2022	11.151.360,00	1,20%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	D+0	15/08/2024	11.157.907,50	1,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+0	Não possui	165.611.120,55	17,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IDKA IPCA 2A	D+0	Não há	13.137.189,49	1,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B 5	D+0	Não há	14.543.579,76	1,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	D+0	Não há	5.843.282,76	0,63%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	GESTÃO DURATION	D+3	Não há	12.085.751,88	1,30%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+4	Não há	442.298,39	0,05%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	GESTÃO DURATION	D+1	Não há	3.195.966,41	0,34%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	IMA-B	D+1	Não há	17.531.646,52	1,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	D+1	Não há	13.577.727,66	1,46%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	IMA-B 5	D+1	Não há	25.170.542,94	2,71%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	IMA-B 5	D+1 du ou D+5 du	Não há	10.005.946,43	1,08%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	FIDC	Não se aplica	Não se aplica	61.806,76	0,01%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+4	Não há	16.715.355,24	1,80%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	D+30	Não há	10.982.892,87	1,18%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	D+29	Não há	2.292.926,14	0,25%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+4	Não há	35.340.522,62	3,80%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+4 ou D+33	Não há	8.378.265,73	0,90%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	AÇÕES - DIVIDENDOS	D+3	Não há	7.728.558,41	0,83%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+23	Não há	8.690.516,43	0,93%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+15	Não há	2.234.710,74	0,24%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	D+4	Não há	21.922.974,12	2,36%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	AÇÕES - DIVIDENDOS	D+32	Não há	6.868.080,90	0,74%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+24	Não há	12.697.246,90	1,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	D+24	Não há	10.745.697,81	1,16%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+23	Não há	6.538.235,86	0,70%
META VALOR FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+4	Não há	23.729.627,13	2,55%
MULTINVEST FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+11	Não há	5.044.455,63	0,54%
OCCAM FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+4 ou D+18	Não há	19.885.142,94	2,14%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+13	Não há	10.993.586,76	1,18%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	D+4	Não há	9.112.579,79	0,98%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	D+6	Não há	7.932.436,65	0,85%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	MULTIMERCADO - MODERADO	D+5 du	Não há	2.051.005,09	0,22%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	MULTIMERCADO - MODERADO	D+11	Não há	1.716.195,16	0,18%
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.784.731,93	0,30%
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.850.422,33	1,17%
BB RECEÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	FUNDO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica	3.102.132,69	0,33%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	FUNDO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica	3.999.999,50	0,43%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLSJ11	FUNDO IMOBILIÁRIO	S/Info	Não se aplica	14.048.900,26	1,51%
				930.296.012,91	

Fonte: Sistema Crédito e Mercado posição de dezembro de 2020

Distribuição Estratégica – dezembro/2020

Sub-Segmento	Posição R\$	%
TÍTULOS PÚBLICOS	275.692.461,41	29,63%
GESTÃO DURATION	194.912.864,89	20,95%
IDKA IPCA 20A - IMA-B 5+	0,00	0,00%
IMA-B - IMA-GERAL - IMA-GERAL EX-C - IDKA IPCA 5A	68.298.608,87	7,34%
IRF-M - IRF-M 1+	0,00	0,00%
IMA-B 5 - IDKA IPCA 2A - IDKA IPCA 3A - IDKA PRÉ 2A	103.604.582,57	11,14%
IRF-M 1 - IMA-S	21.338.488,78	2,29%
CDI - IPCA	0,00	0,00%
POUPANÇA - OP COMPROMISSADAS - CDB - CVS - DISPONIBILIDADE	0,00	0,00%
FIDC - ABERTO - FIDC - FECHADO - CRÉDITO PRIVADO	61.806,76	0,01%
AÇÕES (dividendos, exterior, indexado, índice ativo, livres, setoriais, small e valor)	219.901.376,02	23,64%
MULTIMERCADO (alocação, conservador, crédito privado, exterior, long short, macro, moderado e outros)	11.699.636,90	1,26%
FUNDO IMOBILIÁRIO	21.151.032,45	2,27%
FIP	13.635.154,26	1,47%
DÍVIDA EXTERNA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR - BDR NÍVEL I	0,00	0,00%
930.296.012,91		100,00%

Distribuição em %



A carteira de investimentos do ANGRAPREV está segregada entre os segmentos de renda fixa e renda variável, sendo 71,37% e 28,63% respectivamente; não ultrapassando o limite de 30% permitido pela Resolução CMN nº 3.922/2010 para o segmento de renda variável.

Retratando uma gestão arrojada, a carteira de investimentos do ANGRAPREV 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 e longo prazo, bem como uma carteira de títulos públicos com marcação a mercado. Ainda se tratando de renda fixa, a segundo maior exposição está em fundos de investimentos classificados como de *gestão duration*, perdendo apenas para a carteira de títulos públicos com marcação a mercado. Apresenta ainda uma singela exposição em fundos de investimentos em direitos creditórios.

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

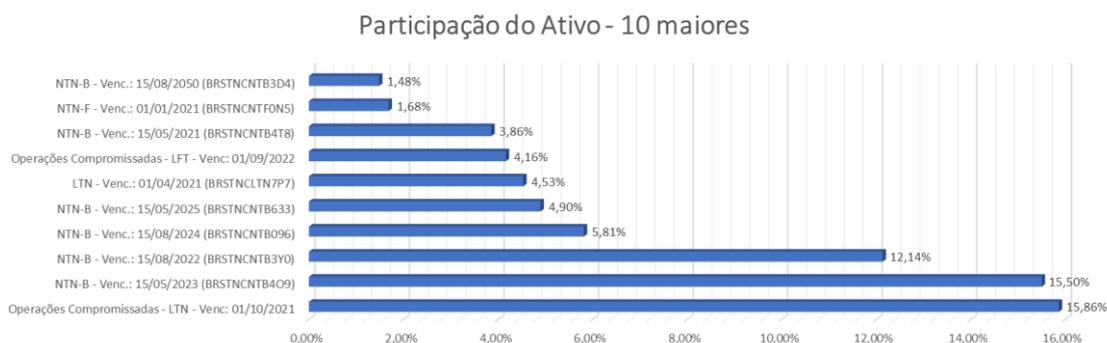
Entre os fundos de investimentos em ações, suas classificações estão segregadas entre as estratégias:

- **LIVRE:** não tem o compromisso de concentração em uma estratégia específica, onde a parcela em caixa pode ser investida em quaisquer ativos, desde que especificados em regulamento;
- **ÍNDICE ATIVO:** têm como objetivo superar o índice de referência do mercado acionário se utilizando de deslocamentos táticos em relação à carteira de referência para atingir seu objetivo;
- **VALOR:** que buscam retorno por meio da seleção de empresas cujo valor das ações negociadas esteja abaixo do “preço justo” estimado (estratégia valor) e/ou aquelas com histórico e/ou perspectiva de continuar com forte crescimento de lucros, receitas e fluxos de caixa em relação ao mercado (estratégia de crescimento);

- **DIVIDENDOS:** Fundos que investem em ações de empresas com histórico de *dividend yield* (renda gerada por dividendos) consistente ou que, na visão do gestor, apresentem essas perspectivas e
- **SMALL CAPS:** Fundos cuja carteira é composta por, no mínimo, 85% em ações de empresas que não estejam incluídas entre as 25 maiores participações do IBrX - Índice Brasil, ou seja, ações de empresas com relativamente baixa capitalização de mercado. Os 15% remanescentes podem ser investidos em ações de maior liquidez ou capitalização de mercado, desde que não estejam incluídas entre as dez maiores participações do IBrX – Índice Brasil.

Para finalizar, a carteira de investimentos do ANGRAPREV apresenta exposição em fundos de investimentos classificado como imobiliário e em participações.

Distribuição Consolidada da Carteira – dezembro/2020



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



A distribuição consolidada da carteira de investimento do ANGRAPREV 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 83,29% do total do patrimônio. Há também participação em ações, debêntures e em fundos de investimentos, que representam o somatório de 15,72% do total do

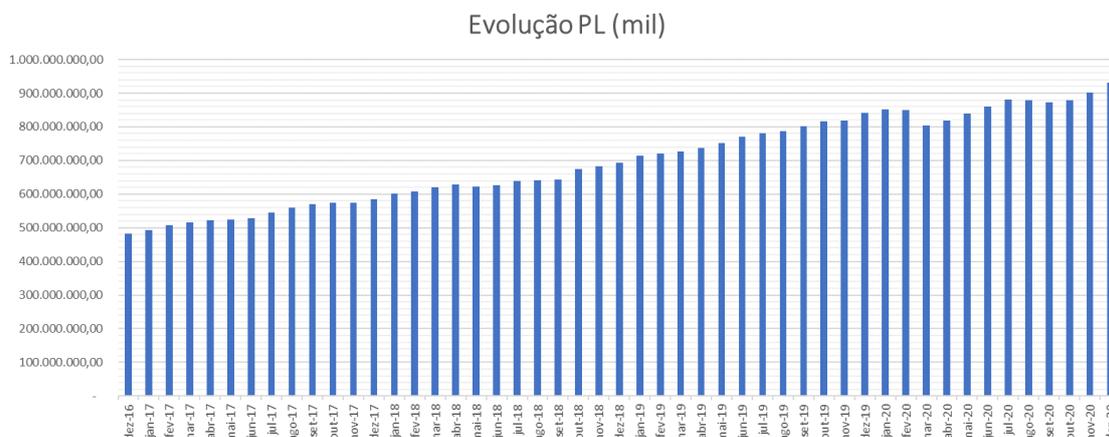
patrimônio, além de outros demais ativos com participações menores, que representam 0,98%.

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.

Não foi possível apresentar análise adequada devido ao não fornecimento do relatório de solvabilidade ou simplesmente ALM – Asset Liabilities Management por parte do RPPS.

Evolução Patrimonial

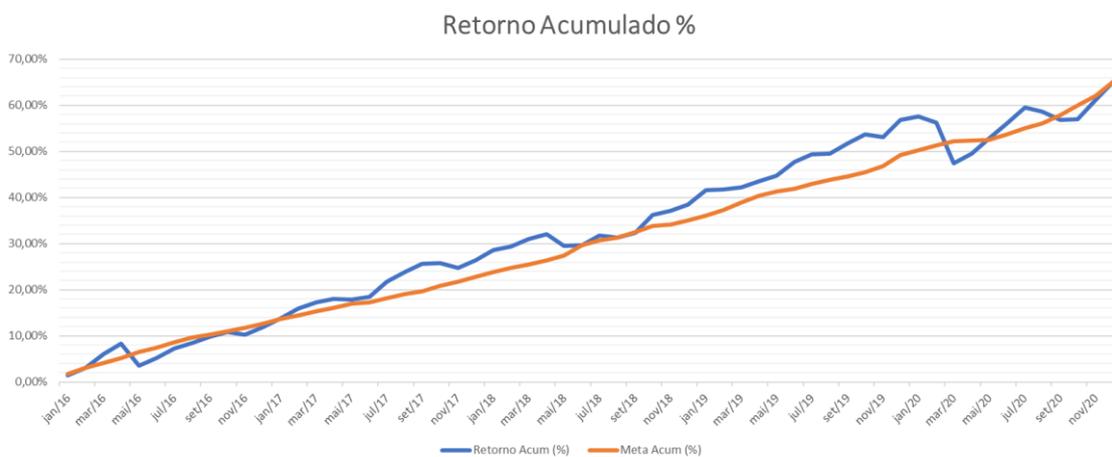


Destaca-se um crescimento contínuo e de boa curvatura evolutiva, não havendo períodos de retração ou declínio contínuo, havendo uma pequena diminuição do patrimônio líquido ainda no primeiro trimestre de 2020, resultado esse devido ao péssimo desempenho do mercado financeiro.

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 ANGRAPREV 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 ANGRAPREV, que tentem a reproduzir a volatilidade do mercado, uma vez que a carteira de investimentos apresenta exposição em ativos de alta volatilidade, porém, com a diversificação equilibrada e certa, as retrações poderão ser discretas ou quase imperceptíveis, apresentando posteriormente uma recuperação gradativa.

Rentabilidade



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

O atingimento da meta de rentabilidade, representa 65,14% de meta de rentabilidade estabelecida contra 65,28% de rentabilidade obtida pela carteira de investimentos do ANGRAPREV.

Rentabilidade da Carteira de Investimentos

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO	ACUM
2016	Carteira	1,47%	1,63%	2,85%	2,17%	-4,51%	1,60%	2,09%	1,01%	1,24%	0,97%	-0,50%	1,48%	11,90%	11,90%
	Meta	1,74%	1,34%	0,94%	1,08%	1,27%	0,86%	1,01%	0,98%	0,57%	0,72%	0,64%	0,81%	12,63%	12,63%
2017	Carteira	1,66%	1,94%	1,18%	0,61%	-0,20%	0,50%	2,82%	1,77%	1,36%	0,12%	-0,81%	1,30%	12,90%	26,34%
	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%	22,82%
2018	Carteira	1,83%	0,51%	1,26%	0,86%	-1,89%	0,02%	1,68%	-0,36%	0,75%	2,98%	0,63%	1,01%	9,60%	38,46%
	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%	34,98%
2019	Carteira	2,24%	0,17%	0,27%	1,00%	0,84%	2,05%	1,06%	0,13%	1,45%	1,31%	-0,37%	2,38%	13,23%	56,77%
	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%	49,27%
2020	Carteira	0,50%	-0,80%	-5,71%	1,47%	2,15%	2,14%	2,21%	-0,52%	-1,11%	0,08%	2,66%	2,54%	5,42%	65,28%
	Meta	0,71%	0,66%	0,57%	0,14%	0,07%	0,74%	0,88%	0,72%	1,12%	1,34%	1,35%	1,86%	10,63%	65,14%

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

Em se tratando da rentabilidade para o exercício de 2020, o ANGRAPREV obteve no período de referência o resultado de 5,42%, permitindo a recuperação do seu resultado acumulado. A meta de rentabilidade, por sua vez, fechou o período de referência com o resultado de 10,62%.

Controle de Risco

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

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

Para considerarmos a relação Risco x Retorno observando também critérios como Volatilidade e VaR – Value at Risk, sendo o segundo, adotado pelo LEMEPREV para controle do risco de mercado.

Análise de Risco– carteira de dezembro/2020

	Dezembro de 2020				
	Retorno	VaR (95% MV 21 du)	VaR (95% MV 21 du)		
			Renda Fixa	Renda Variável	Invst. Exterior
Carteira de Investimentos	2,54%	2,79%	0,68%	6,23%	0,00%

Produto / Fundo	Dezembro de 2020		
	Retorno	Volatilidade	VaR (95% MV 21 du)
OCCAM FIC AÇÕES	10,11%	16,85%	8,00%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,08%	11,71%	5,56%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	8,92%	13,48%	6,40%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	8,40%	14,60%	6,93%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	8,24%	37,77%	17,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,97%	13,79%	6,55%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	7,95%	13,22%	6,28%
MULTINVEST FI AÇÕES	7,79%	14,50%	6,88%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7,70%	13,95%	6,62%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,67%	12,91%	6,13%
META VALOR FI AÇÕES	7,50%	14,39%	6,83%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	7,12%	13,37%	6,35%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,93%	12,35%	5,87%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6,93%	12,35%	5,86%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,30%	12,90%	6,12%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,28%	13,73%	6,52%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6,00%	14,59%	6,93%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,23%	14,34%	6,81%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4,94%	4,36%	2,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,84%	4,28%	2,03%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4,17%	10,95%	5,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	2,30%	1,09%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	2,62%	2,09%	0,99%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,48%	2,41%	1,14%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	2,15%	3,25%	1,54%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1,97%	1,75%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,82%	1,55%	0,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,81%	1,57%	0,75%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,68%	0,31%	0,15%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,67%	0,31%	0,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	1,49%	0,71%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,42%	1,67%	0,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	1,17%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	1,36%	0,64%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,60%	0,92%	0,44%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	0,21%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,28%	0,21%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,20%	0,04%	0,02%

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

Os resultados apresentados pela carteira de investimentos do ANGRAPREV são reflexo da retomada do mercado, porém não estão isentos de novas oscilações, mantendo-se a 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 2020 e, caso haja o descasamento, para a regularização, sugerimos ater para as Políticas de Contingências.

O otimismo para os retornos positivos advindos dos fundos de investimentos de ações se mantém, com novas perspectivas e novas altas, principalmente para o exercício de 2021, proporcionado maior rentabilidade para a carteira de investimentos, contudo, deve-se analisar o cenário econômico uma vez que os mercados, nacional e internacional, ainda estão sofrendo com o impacto do vírus COVID-19.

Históricos de Movimentações

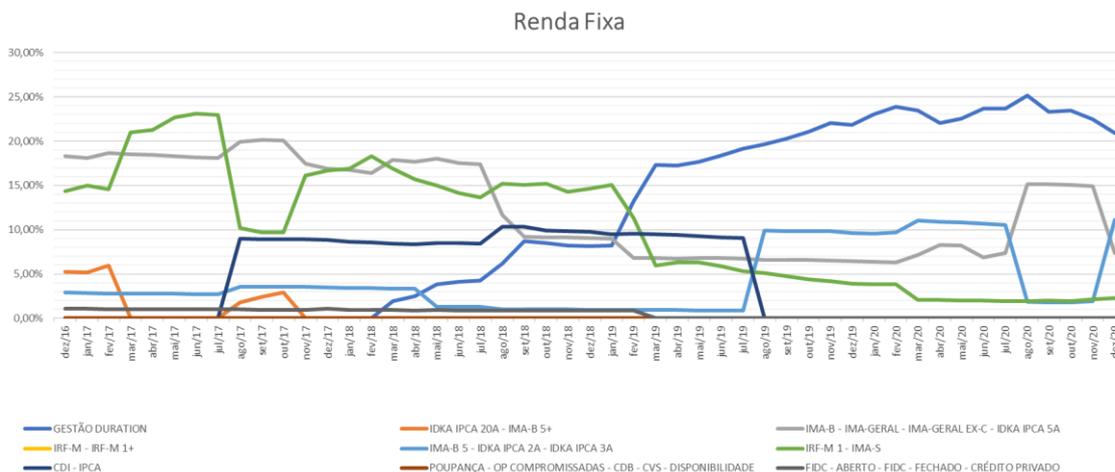
Histórico de Movimentações para o 2º Semestre/2020

Fundos de Investimentos	jul-20	ago-20	set-20	out-20	nov-20	dez-20
TÍTULOS PÚBLICOS	272.645.284,99	271.048.396,66	272.408.628,50	274.346.527,31	273.935.955,60	275.692.461,41
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.985.999,81	10.782.357,26	10.614.643,60	10.635.427,76	10.847.407,06	11.371.969,49
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.356.311,76	15.392.377,30	15.398.957,83	15.416.420,15	15.446.865,96	15.495.206,02
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	14.543.579,76
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.929.561,93	1.774.158,37	1.771.524,54	1.774.055,98	3.802.333,22	5.843.282,76
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.851.301,24	16.568.585,49	16.601.109,14	16.683.873,31	16.880.404,61	17.085.725,36
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.806.975,00	10.597.672,50	10.691.167,50	10.830.105,00	10.967.730,00	11.151.360,00
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.812.435,00	10.601.055,00	10.695.285,00	10.835.002,50	10.973.377,50	11.157.907,50
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	23.171,36	49.147,75	67.878,41	67.104,03	67.361,45	61.806,76
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.319.258,41	9.987.736,31	9.391.530,88	9.203.258,73	10.271.530,61	10.982.892,87
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	7.270.923,21	6.941.701,24	6.599.359,33	6.447.709,47	7.291.292,10	7.728.558,41
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	7.769.535,34	7.395.260,91	7.181.117,44	7.052.936,96	7.967.254,29	8.690.516,43
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5.518.650,85	5.375.069,13	5.093.618,15	4.999.982,88	5.622.305,82	10.993.586,76
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.694.526,91	3.044.700,38	3.021.468,55	3.031.729,12	3.110.302,02	3.102.132,69
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	12.382.577,25	12.422.038,72	12.452.507,36	13.143.666,19	13.846.875,98	14.048.900,26
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	107.888.212,07	184.900.175,31	167.567.067,83	169.248.268,44	166.049.904,33	165.611.120,55
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	10.944.803,43	10.929.264,31	10.912.840,99	10.886.631,74	10.869.983,65	10.850.422,33
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	65.268.368,29	399.311,83	429.435,34	428.241,79	431.595,85	442.298,39
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	26.077.105,87	25.220.683,43	24.116.446,49	23.907.881,84	27.730.819,31	35.340.522,62
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.317.816,75	9.912.846,59	9.116.514,65	8.736.400,39	9.952.543,90	10.745.697,81
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	5.428.570,75	5.142.856,50	4.457.142,30	4.514.285,15	4.514.285,15	3.999.999,50
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	8.068.318,67	8.024.019,30	7.972.371,46	7.922.220,68	7.885.235,97	7.932.436,65
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.702.318,43	9.510.354,04	8.921.531,71	8.865.903,29	10.688.342,61	16.715.355,24
OCCAM FIC AÇÕES	11.935.255,94	11.668.032,06	11.000.484,32	10.966.369,97	13.289.746,91	19.885.142,94
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	15.711.401,68	14.804.750,26	13.894.963,73	13.764.812,58	15.693.099,82	21.922.974,12
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.091.816,71	1.106.352,87	1.040.232,67	1.046.416,93	1.046.867,59	3.195.966,41
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	11.160.805,43	11.138.920,31	10.586.293,25	10.639.004,25	11.945.252,68	12.697.246,90
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	23.584.305,87	23.554.892,14	23.500.892,57	23.519.129,73	23.543.726,04	13.577.727,66
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.443.815,77	15.500.453,54	15.476.638,08	15.505.528,43	17.422.714,74	40.747.323,95
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.151.709,67	2.084.260,22	1.960.168,93	1.920.694,71	2.144.398,21	2.292.926,14
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.887.028,08	2.874.545,59	2.789.302,78	2.741.037,20	2.978.949,20	8.378.265,73
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	5.801.170,25	5.719.340,76	5.490.544,77	5.392.921,57	6.031.705,07	6.538.235,86
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.706.254,49	1.687.287,25	1.651.333,00	1.662.557,77	1.680.051,06	1.716.195,16
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.344.584,23	84.492.491,49	83.083.115,67	83.082.700,94	84.809.094,35	17.531.646,52
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.721.491,24	3.659.103,88	3.368.570,14	3.247.640,12	3.667.652,20	9.112.579,79
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.784.183,74	11.091.445,24	11.021.321,57	11.651.000,70	11.768.416,72	12.085.751,88
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.016.644,07	2.023.063,79	2.011.589,30	2.003.967,10	2.022.294,58	2.051.005,09
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	0,00	1.884.532,70	1.852.819,09	2.102.587,55	2.234.710,74
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	0,00	0,00	1.429.146,80	1.400.999,18	1.590.373,97	6.868.080,90
META VALOR FI AÇÕES	0,00	0,00	15.732.446,91	15.389.564,37	17.290.299,84	23.729.627,13
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	0,00	0,00	0,00	2.823.806,91	2.805.045,50	2.784.731,93
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	13.137.189,49
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	25.170.542,94
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10.005.946,43
MULTINVEST FI AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5.044.455,63
881.679.984,64	879.610.921,34	872.302.505,93	878.356.906,54	902.875.086,80	930.296.012,91	

Movimentações de dezembro/2020

Produto / Fundo	Benchmark	Data de Movimentação	Movimento R\$	Benchmark	Movimento R\$ Final
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	IMA-B 5	30/12/2020	10.000.000,00	IMA-B 5	72.425.410,29
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	14/12/2020	5.000.000,00	AÇÕES - VALOR	25.000.000,00
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	IMA-B 5	17/12/2020	25.000.000,00	GESTÃO DURATION	-10.639.663,73
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	14/12/2020	5.000.000,00	IMA-B	-70.000.000,00
OCCAM FIC AÇÕES	AÇÕES - VALOR	11/12/2020	5.000.000,00	MULTIMERCADO - MODERADO	-2.061.184,49
MULTINVEST FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	18/12/2020	5.000.000,00	AÇÕES - DIVIDENDOS	5.000.000,00
META VALOR FI AÇÕES	AÇÕES - VALOR	14/12/2020	5.000.000,00	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.000.000,00
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	11/12/2020	-10.000.000,00	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	-13.093.862,25
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	IMA-B	11/12/2020	-70.000.000,00	IRF-M 1	2.026.804,00
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	GESTÃO DURATION	28/12/2020	2.064.285,44	IDKA IPCA 2A	13.093.862,25
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	MULTIMERCADO - MODERADO	28/12/2020	-2.061.184,49	MULTIMERCADO - MACRO	-14.488.776,16
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	AÇÕES - DIVIDENDOS	14/12/2020	5.000.000,00	AÇÕES - LIVRES	20.024.000,00
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11/12/2020	5.000.000,00	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	-22.936.634,13
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	23/12/2020	-13.093.862,25		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	10/12/2020	2.026.804,00		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B 5	23/12/2020	14.488.776,16		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IDKA IPCA 2A	23/12/2020	13.093.862,25		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	02/12/2020	550.000,00		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	04/12/2020	40.000,00		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	09/12/2020	230.000,00		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	11/12/2020	35.000.000,00		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	17/12/2020	-26.350.000,00		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	17/12/2020	-987.288,26		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	23/12/2020	275.000,00		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	28/12/2020	-2.031.439,91		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	30/12/2020	569.779,00		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	GESTÃO DURATION	30/12/2020	-10.000.000,00		
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	MULTIMERCADO - MACRO	23/12/2020	-14.488.776,16		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	11/12/2020	5.000.000,00		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	11/12/2020	5.000.000,00		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	24/12/2020	22.936.634,13		
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	18/12/2020	-3.764.844,88		
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	18/12/2020	-53,44		
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	18/12/2020	-8.210.477,73		
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	18/12/2020	-10.930.183,86		
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	18/12/2020	-31.074,22		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	15/12/2020	5.024.000,00		
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	AÇÕES - LIVRES	14/12/2020	5.000.000,00		

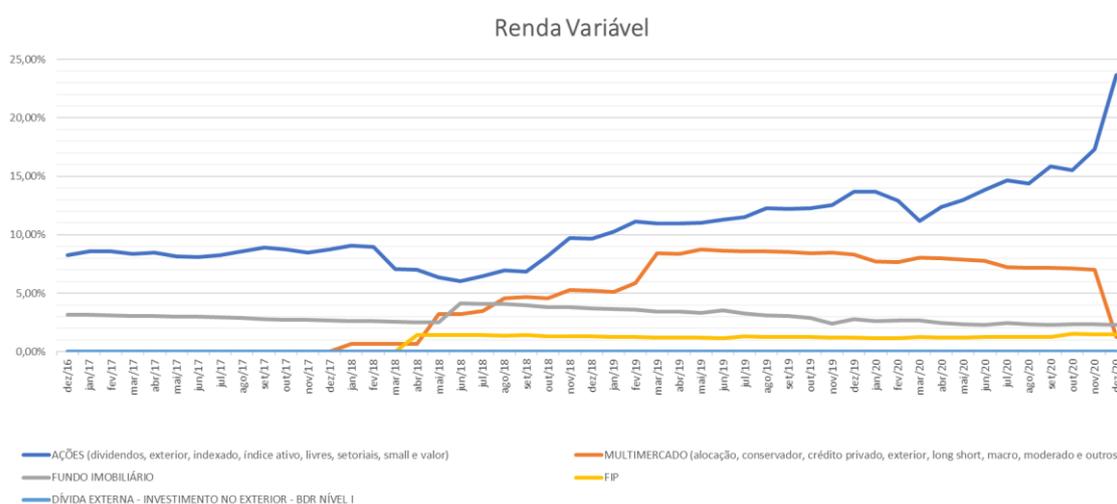
Histórico de Movimentações Acumuladas



A exposição em renda fixa sai de grande concentração em fundos de investimentos compostos por 100% em títulos públicos, atrelados a vértices de longo e curto prazo, trazendo oscilações dessas exposições no exercício de 2017 completo. No início do exercício de 2018, houve uma redução drástica na posição dos fundos de investimentos atrelados aos vértices já citados, sendo realocados em fundos de investimentos classificados como sendo de gestão *duration*.

Podemos ainda destacar a exposição em fundos de investimentos compostos por 100% títulos públicos atrelados a vértices de médio prazo que vem alçando no decorrer dos dois últimos exercícios, uma posição significativa no patrimônio líquido do ANGRAPREV, sendo posteriormente reduzida ao final do exercício de 2020. Podemos destacar ainda uma singela exposição em fundos de investimentos compostos por 100% títulos públicos, atrelados a vértices de longuíssimo prazo com início em meados do final do exercício de 2016, se mantendo até o primeiro trimestre de 2017.

Desde o final do exercício de 2019 e início do exercício de 2020 a carteira de investimento do ANGRAPREV vem seguindo a mesma estratégia, invertendo a exposição dos fundos de investimentos compostos por 100% títulos públicos atrelados a vértices de médio prazo com os fundos de investimentos compostos por 100% títulos públicos atrelados a vértices de longo prazo no final do segundo semestre de 2020.



A introdução de renda variável na carteira de investimentos do ANGRAPREV iniciou-se no nosso banco de dados, contemplando fundos de investimentos classificados como ações e imobiliário; sendo posteriormente, ao final do exercício de 2017, a iniciação em fundos de investimentos multimercado.

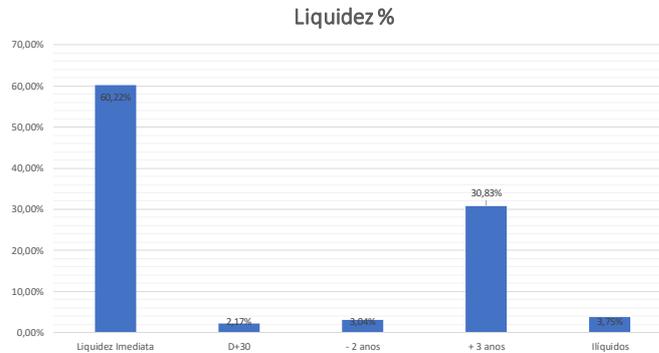
Em março de 2018, o ANGRAPREV aumentou significativamente sua exposição em renda variável, inclusive com a busca de oportunidades em fundos de investimentos em participações.

A exposição em fundos de investimentos em ações se apresenta em alta no gráfico, inclusive no período de análise, onde o ANGRAPREV buscou o aumento de exposição neste subsegmento.

Liquidez

A carteira de investimentos possui liquidez imediata de 62,38% para auxílio no cumprimento das obrigações do ANGRAPREV.

Disponibilidade	Saldo	%
Liquidez Imediata	560.216.665,26	60,22%
D+30	20.143.899,91	2,17%
- 2 anos	28.237.085,36	3,04%
+ 3 anos	286.850.368,91	30,83%
Ilíquidos	34.847.993,47	3,75%
	930.296.012,91	



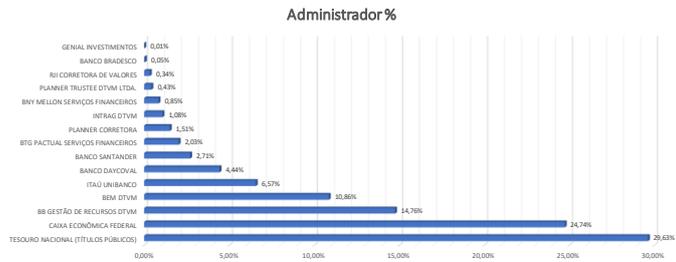
Indicamos aos gestores do ANGRAPREV que a importância de compreender a necessidade da exposição da carteira de investimentos em ativos de menor liquidez, demonstra que os membros dirigentes objetivam retornos no longo prazo, possibilitam ao regime próprio arcar com seus compromissos futuros frente aos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

ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

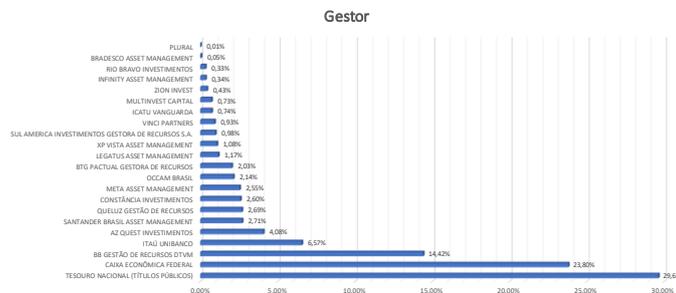
Instituições Financeiras

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

Administrador	Valor	% s/ Carteira
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	275.692.461,41	29,63%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	230.134.956,49	24,74%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	137.279.637,10	14,70%
BEM DTVM	101.008.345,50	10,86%
ITAU UNIBANCO	61.090.554,75	6,57%
BANCO DAYCOVAL	41.340.700,25	4,44%
BANCO SANTANDER	25.170.542,94	2,71%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	18.891.556,07	2,03%
PLANNER CORRETORA	14.048.900,26	1,51%
INTRAG DTVM	10.005.946,43	1,08%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	7.932.436,65	0,85%
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	3.999.999,50	0,43%
RJI CORRETORA DE VALORES	3.195.966,41	0,34%
BANCO BRADESCO	442.298,39	0,05%
GENIAL INVESTIMENTOS	61.806,76	0,01%
Total	930.296.012,91	



Gestor	Valor	% s/ Carteira
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	275.692.461,41	29,63%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	221.444.440,06	23,80%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	134.177.504,41	14,42%
ITAU UNIBANCO	61.090.554,75	6,57%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	37.932.610,90	4,08%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	25.170.542,94	2,71%
QUELIZ GESTÃO DE RECURSOS	25.042.487,02	2,69%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	24.157.684,86	2,60%
META ASSET MANAGEMENT	23.729.627,13	2,55%
OCCAM BRASIL	19.885.142,84	2,14%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	18.891.556,07	2,03%
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	10.850.422,33	1,17%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	10.005.946,43	1,08%
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	9.112.579,79	0,98%
VINCI PARTNERS	8.690.516,43	0,93%
ICATU VANGUARDIA	6.868.080,90	0,74%
MULTINVEST CAPITAL	6.760.650,79	0,73%
ZION INVEST	3.999.999,50	0,43%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.195.966,41	0,34%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.102.132,69	0,33%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	442.298,39	0,05%
PLURAL	61.806,76	0,01%
Total	930.296.012,91	



Análise da Situação das Instituições Financeiras

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

Análise das Instituições Financeiras

Instituição Financeira	Res. CMN nº 3.922/10, Art. 15º	Patrimonial	Fiscal	Comercial	Jurídica
AZ QUEST INVESTIMENTOS	✗	✓	✓	✓	✓
BANCO BRADESCO	✓	✓	✓	✓	✓
BANCO DAYCOVAL	✓	✓	✓	✓	✓
BANCO SANTANDER	✓	✓	✓	✓	✓
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
BEM DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	✗	✓	✓	!	✓
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	✓	✓	✓	✓	✓
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	✓	✓	✓	✓	✓
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	✓	✓	✓	✓	✓
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	✓	✓	✓	✓	✓
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	✗	✓	✓	✓	✓
GENIAL INVESTIMENTOS	✗	✓	✓	✓	✓
ICATU VANGUARDA	✗	✓	✓	✓	✓
INFINITY ASSET MANAGEMENT	✗	✓	✓	✓	✓
INTRAG DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
ITAÚ UNIBANCO	✓	✓	✓	✓	✓
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	✗	✓	✓	✓	✓
META ASSET MANAGEMENT	✗	✓	✓	✓	✓
MULTINVEST CAPITAL	✗	✓	✓	✓	✓
OCCAM BRASIL	✗	✓	✓	✓	✓
PLANNER CORRETORA	✗	✓	✓	✓	✓
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	✗	✓	✓	✓	✓
PLURAL	✗	✓	✓	✓	✓
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	✗	✓	✓	✓	✓
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	✗	✓	✓	✓	✓
RJI CORRETORA DE VALORES	✗	✓	✓	!	!
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	✓	✓	✓	✓	✓
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	✗	✓	✓	✓	✓
VINCI PARTNERS	✗	✓	✓	✓	✓
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	✗	✓	✓	✓	✓
ZION INVEST	✗	✓	✓	✓	✓

Da análise aplicada, podemos destacar as Instituições Financeiras: BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS e RJI CORRETORA DE VALORES por terem algum tipo de citação em Operações da Política Federal e/ou ações do Ministério Público.

Ainda com referência a RJI CORRETORA DE VALORES conseguimos identificar processos em que há sua menção, passível de maior exploração. São os processos:

- Processo nº 1003437-09.2019.8.26.0053
- Processo nº 1124044-80.2014.8.26.0100
- Processo nº 2208317-08.2019.8.26.0000
- Processo nº 0064325-14.2019.8.26.0100

Recomendamos que o ANGRAPREV, antes de qualquer medida ou ação, venha junto aos prestadores de serviços dos fundos de investimentos solicitar esclarecimentos sobre as informações aqui prestadas.

ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.987.516.426,31 (Quatro bilhões, novecentos e oitenta e sete milhões, quinhentos e dezesseis mil, quatrocentos e vinte e seis reais e trinta e um centavos).

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

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 7.469.433.784,87 (Sete bilhões, quatrocentos e sessenta e nove milhões, quatrocentos e trinta e três mil, setecentos e oitenta e quatro reais e oitenta e sete centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (89,84%), Operações Compromissadas em Títulos Públicos (10,15%) e Derivativos (0,01%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 8.693.778.987,76 (Oito bilhões, seiscentos e noventa e três milhões, setecentos e setenta e oito mil, novecentos e oitenta e sete reais e setenta e seis centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (89,56%), Operações Compromissadas em Títulos Públicos (10,43%) e derivativos (0,01%), representando 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 8.522.749.810,66 (Oito bilhões, quinhentos e vinte e dois milhões, setecentos e quarenta e nove mil, oitocentos e dez reais e sessenta e seis centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta exclusivamente pelas cotas do BB IRF-M 1 Fundo de Investimento de Renda Fixa (CNPJ: 11.839.250/0001-36), 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.

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 8.522.821.514,69 (Oito bilhões, quinhentos e vinte e dois milhões, oitocentos e vinte e um mil, quinhentos e quatorze reais e sessenta e nove centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (74,11%) e por Operações Compromissadas em Títulos Públicos (25,89%), representando o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Não há informações sobre 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 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 carência, taxas de ingresso, saída ou performance cobradas pelo fundo.

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

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

O fundo tem por objetivo proporcionar a 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., 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\$ 518.693.988,11 (Quinhentos e dezoito milhões, seiscentos e noventa e três mil, novecentos e oitenta e oito reais e onze centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (99,89%), Operações Compromissadas em Títulos Públicos (0,1%) e valores a pagar ou receber (0,02%), representando o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Foram localizados dois fatos relevantes, publicados em 08 de junho de 2018 (informando que nos termos dos artigos 19 § 1º e 60 § 2º da Instrução CVM 555/14 e alterações posteriores, vem informar a reabertura do Fundo para novas aplicações a partir do dia 11 de junho de 2018, por tempo indeterminado) e em 19 de junho de 2018 (informando que nos termos dos artigos 19 e 60 da Instrução CVM 555/14 e alterações posteriores, vem informar o fechamento do Fundo para novas aplicações a partir do dia 19/06/2018, por prazo indeterminado.).

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

Não há informações sobre 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.

CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 18.598.117/0001-84)

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, que está 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 proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, busca acompanhar o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo – IPCA + 6,0% a.a., 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\$ 86.344.692,42 (Oitenta e seis milhões, trezentos e quarenta e quatro mil, seiscentos e noventa e dois reais e quarenta e dois centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por Títulos Públicos Federais (99,81%), Operações Compromissadas em Títulos Públicos (0,17%) e valores a pagar ou receber (0,02%), representando o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Não há informações sobre 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.

CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (CNPJ: 18.598.088/0001-50)

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, que está 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 proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, busca acompanhar o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo – IPCA + 6,0% a.a., 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\$ 200.132.105,82 (Duzentos milhões, cento e trinta e dois mil, cento e cinco reais e oitenta e dois centavos).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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\$ 14.722.139.597,34 (Quatorze bilhões, setecentos e vinte e dois milhões, cento e trinta e nove mil, quinhentos e noventa e sete reais e trinta e quatro centavos).

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 detalhado adequadamente a seguir.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Não há informações sobre 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.

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

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

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

Os serviços de custódia dos ativos financeiros do fundo também são realizados pela Caixa Econômica Federal.

O fundo tem por objetivo proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, 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\$ 368.573.654,37.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: títulos públicos (79,34%) e operações compromissadas em títulos públicos (20,66%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Não há informações sobre 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.

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

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

O fundo é administrado e gerido pela Caixa Econômica Federal (CNPJ: 00.360.305/0001-04), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório 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 Índice de Duração Constante ANBIMA – segmento IPCA 2A (IDkA IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da Administradora.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 10.655.087.063,09 (Dez bilhões, seiscentos e cinquenta e cinco milhões, oitenta e sete mil, sessenta e três reais e nove centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: títulos públicos federais (95,54%), operações compromissadas em títulos públicos (4,45%) e valores a pagar ou receber (0,01%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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 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, 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\$ 20.761.505.098,56 (Vinte bilhões, setecentos e sessenta e um milhões, quinhentos e cinco mil, noventa e oito reais e cinquenta e seis centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: títulos públicos federais (97,67%), operações compromissadas em títulos públicos (2,32%) e valores a pagar ou receber (0,01%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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\$ 16.753.976.831,37 (Dezesseis bilhões, setecentos e cinquenta e três bilhões, novecentos e setenta e seis mil, oitocentos e trinta e um reais e trinta e sete centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: operações compromissadas em títulos públicos (76,99%), títulos públicos federais (23%) e valores a pagar ou receber (0,01%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.667.113.282,02 (Dois bilhões, seiscentos e sessenta e sete milhões, cento e treze mil, duzentos e oitenta e dois reais e dois centavos).

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

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por cotas de fundos, que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo, 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 30 de junho de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

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

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

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

O fundo é administrado pelo Banco Bradesco S.A. (CNPJ: 60.746.948/0001-12), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório CVM n.º 1085, de 30 de agosto de 1989.

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.422.915.185,87 (Um bilhão, quatrocentos e vinte e dois milhões, novecentos e quinze mil, cento e oitenta e cinco reais e oitenta e sete centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: cotas de fundos de investimentos (100%), sendo BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI (47,57%), BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA (25,43%), 1BRAM IMA-B FI RENDA FIXA (24,92%); BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA (5,02%); BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA (3,05%); BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA (0,05%).

A composição final consolidada da carteira do fundo de investimento em análise, corresponde a: títulos públicos (87,41%); Operação compromissada em títulos públicos (12,26%); Debêntures (0,27%) e Derivativos (0,01%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de novembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis

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

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

INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 15.188.380/0001-07)

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 RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ: 42.066.258/0001-30 e 42.066.258/0002-11), devidamente autorizada à prestação dos referidos serviços por meio do Ato Declaratório da Comissão de Valores Mobiliários nº 15.391, expedido em 15 de dezembro de 2016.

A gestão da carteira do Fundo é realizada pela Infinity Asset Management Administração de Recursos Ltda. (CNPJ: 03.403.181/0001-95), devidamente autorizada à prestação dos referidos serviços por meio do Ato Declaratório CVM nº 5758, expedido em 08 de dezembro de 1999.

A custódia dos ativos financeiros do Fundo também é realizada pela RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ: 42.066.258/0001-30 e 42.066.258/0002-11), devidamente autorizada à prestação dos referidos serviços por meio do Ato Declaratório da Comissão de Valores Mobiliários nº 15.391, expedido em 15 de dezembro de 2016.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, no longo prazo, rentabilidade sobre o principal investido buscando superar a variação do Certificado de Depósito Interbancário – CDI, através da aplicação dos recursos em uma carteira diversificada de ativos financeiros, conforme definido neste regulamento, na Instrução CVM nº 555/14, e atualizações, disponíveis no âmbito do mercado financeiro.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 104.906.048,83 (Cento e quatro milhões, novecentos e seis mil, quarenta e oito reais e oitenta e três centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: valores a pagar ou receber (67,45%), títulos públicos federais (29,41%), ações (2,68%), operações compromissadas em títulos públicos (0,39%) e derivativos (0,06%).

Foram localizados fatos relevantes referentes ao Fundo, publicados em:

26/12/2018: A BRB Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A comunica, nesta data, em caráter irrevogável e irretratável, a sua função de prestadora de serviço de administração fiduciária do Fundo), em 04 de janeiro de 2019 (comunica aos cotistas e ao mercado em geral, em atendimento aos Artigos 19º e 39º da Instrução CVM 555/2014, o fechamento do fundo para a realização de aplicações e resgates, tendo em vista a necessidade de avaliar o enquadramento de suas operações;

17/01/2019: comunica aos cotistas e ao mercado em geral, em atendimento ao Artigo 39º § 1º da Instrução CVM 555/2014, a reabertura fundo para a realização de aplicações

e resgates, conforme deliberação dos cotistas na Assembleia Geral Extraordinária do dia 17/01/2019;

08/04/2019: comunica aos cotistas e ao mercado em geral, em atendimento aos Artigos 19 e 39 da Instrução CVM nº 555/2014, o fechamento do fundo para a realização de aplicações e resgates, a partir desta data, e por prazo indeterminado, uma vez que o Gestor do Fundo, a INFINITY ASSET ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA, não forneceu informações solicitadas pelo Administrador, para fins de avaliação da capacidade de pagamento das contrapartes INFINITY CAPITAL PARTNERS LTDA e INFINITY CORRETORA DE CÂMBIO, TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A.

Por esse motivo, o Administrador solicitou ao Gestor a liquidação de todas as operações com as contrapartes acima indicadas, no prazo de 1 (dia) útil, como medida protetiva aos cotistas do fundo, para propiciar a formação de adequada certeza acerca da liquidez dos referidos ativos, e de seu preço.

07/05/2019: comunica aos cotistas e ao mercado em geral, em atendimento aos Artigos 19 e 39 da Instrução CVM nº 555/2014, a manutenção do fechamento do fundo para a realização de aplicações e resgates, uma vez que não ocorreu a liquidação financeira da totalidade dos ativos de contraparte INFINITY CAPITAL PARTNERS LTDA (ICP) e INFINITY CORRETORA DE CÂMBIO, TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A (INFINITY CCTVM), conforme a proposta do gestor apreciada na assembleia de 30 de abril de 2019; e, por esse motivo, o Administrador procederá à convocação de nova Assembleia.

As operações sem garantia, embora tenham sido desfeitas nas carteiras, tiveram seu financeiro lançado em “Contas a Receber”, de acordo com cronograma informado pelo Gestor, com previsão de liquidação financeira em datas variadas, até 30 de maio de 2019.

17/05/2019: comunica aos cotistas e ao mercado em geral, impacto no valor da cota do FUNDO em 16/05/2019, tendo em vista que possui em sua carteira obrigações pendentes de liquidação financeira, por parte dos ativos de contraparte INFINITY CAPITAL PARTNERS LTDA (“ICP”) e INFINITY CORRETORA DE CÂMBIO, TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A (“INFINITY CCTVM”).

Em atendimento ao Artigo 60 da Instrução CVM nº 555/2014, a divulgação deste Fato Relevante se dá em razão de provisão para créditos de liquidação duvidosa provenientes dos ativos de contraparte ICP e INFINITY CCTVM que, conforme relatado acima, ainda possuem liquidação financeira pendente para com o FUNDO. A referida provisão decorre do fato de que não foi apresentado, pelas contrapartes e pela gestora, o rol de documentos necessários para a avaliação da capacidade financeira de pagamento e mensuração do risco de crédito dessas operações.

Informamos, ainda, que conforme as operações venham a ser liquidadas financeiramente, conforme compromisso firmado pelo Gestor em cronograma por ele proposto, haverá também a reversão de suas respectivas provisões. Por fim, ratificamos

o disposto no Fato Relevante de 07/05/2019, informando que o FUNDO permanece fechado para aplicações e resgates.

06/06/2019: comunica aos cotistas e ao mercado em geral, em atendimento ao Art. 60 da Instrução CVM nº 555/2014, a manutenção do fechamento dos FUNDOS para a realização de aplicações e resgates, tendo em vista o fato de que, embora o Gestor tenha liquidado as operações sem garantia com as contrapartes Infinity Capital Partners e Infinity CCTVM, no dia 31 de maio de 2019, ainda restam pendentes informações que comprovem a liquidez das contrapartes das operações sem garantia remanescentes, quais sejam o INFINITY SELECT FIRF e o INFINITY PODIUM FIM, de outro administrador; e a documentação para análise de risco de crédito das contrapartes finais das operações sem garantia constantes das respectivas carteiras, que permitam a avaliação dos limites de concentração por emissor e do valor das cotas. Após disponibilizadas as informações pelo Gestor, e feitas as análises necessárias por parte deste Administrador, os FUNDOS poderão ser reabertos.

Caso o Gestor liquide as operações sem garantia e realize o resgate das aplicações nos referidos fundos, os FUNDOS poderão ser reabertos de imediato.

03/07/2019: comunica aos cotistas e ao mercado em geral, em atendimento ao Art. 60 da Instrução CVM nº 555/2014, a manutenção do fechamento dos FUNDOS para a realização de aplicações e resgates, dado que ainda dispõem de ativos de baixa liquidez e em virtude da renúncia da BRB DTVM à administração, considerando a ausência de administrador interessado no mercado, há mais de seis meses.

Ressaltamos que caso sejam reabertos, a saída dos recursos de liquidez poderá ensejar prejuízo aos cotistas remanescentes, na hipótese de liquidação dos FUNDOS, já que alguns cotistas somente teriam acesso à integralidade de recursos em prazo desconhecido e o Administrador não pode permitir a transferência de riqueza entre os cotistas.

Salientamos que durante todo o tempo que os FUNDOS permaneceram fechados, este Administrador tomava as ações necessárias para o correto enquadramento, análise da liquidez dos ativos, e avaliação das contrapartes que operam com os FUNDOS, sempre no sentido de minimizar eventual prejuízo aos cotistas, na hipótese de liquidação dos FUNDOS, dado que, até 27 de junho de 2019, não havia proposta formal de substituição do Administrador.

Em 28 de junho de 2019, contudo, a BRB DTVM recebeu proposta para transferência dos FUNDOS e está aguardando o resultado da avaliação do compliance do candidato à administração, para convocação da Assembleia, seja para deliberar pela transferência, seja para deliberar sobre o plano de liquidação;

07/10/2019: comunica aos cotistas e ao mercado em geral, em atendimento ao Art. 60 da Instrução CVM nº 555/2014, que, muito embora tenha sido aprovada em Assembleia a transferência dos FUNDOS para um novo Administrador, este informou, ao final do dia

30 de setembro de 2019, que, por problemas operacionais, não conseguiria finalizar os processos internos para a transferência dos fundos da Infinity Asset nas datas aprovadas (de 1º a 4 de outubro de 2019), não estabelecendo novos prazos. Diante desse posicionamento, a Administradora solicitou tempestivamente ao Gestor que apresentasse novo cronograma ou que providenciasse o plano de liquidação dos FUNDOS, nos termos do que já fora comunicado aos cotistas anteriormente.

Sem a definição de novos prazos pelo Gestor, informamos que, até 11 de outubro de 2019, será convocada Assembleia para deliberar sobre o plano de liquidação dos FUNDOS, confeccionado pelo Gestor ou, no caso de inércia deste, pela BRB DTVM, baseado na liquidez atual dos ativos e conforme Instrução CVM nº 555/2014.

Ressaltamos que a apresentação do plano de liquidação e a convocação da Assembleia não impedirá a transferência dos Fundos, desde que ocorra até o dia de realização da Assembleia, caso em que esta poderá ser cancelada. Com isso, os FUNDOS permanecem fechados para a realização de aplicações e resgates, até que seja concluído o processo de transferência ou liquidação, considerando que o Administrador não pode permitir uma eventual transferência de riqueza entre os cotistas.

12/11/2019: comunicar que a partir de 14 de novembro de 2019 o Fundo será reaberto para novas movimentações por um período indeterminado. Tal decisão aplica-se indistintamente a novos investidores e cotistas atuais, bem como não implica qualquer mudança no Regulamento do Fundo, inclusive no que se refere a sua política de investimento.

29/09/2020: informar que após submeter determinados ativos do Fundo - notadamente, aqueles com lastro em crédito privado vinculado à sociedade Ajuz Business & Solution Administração de Bens Próprios e Participações Ltda., inscrita no CNPJ/ME nº 23.815.709/0001-40 ("Ativos") - a testes de impairment com análises quantitativas e qualificativas, com objetivo de concluir sobre a necessidade de provisionamentos que façam frente a eventuais perdas futuras, procedeu com a remarcação dos Ativos, resultando numa redução de 22.54 pontos-base no saldo acumulado do ativo (data de aplicação apurada diariamente até a data de vencimento), ressalvada hipótese de liquidação antecipada ou negociação ou até mesmo reversão do impairment quando da revisão dos riscos envolvidos e/ou liquidação de 100% da operação sem perda.

A Administradora reforça que referida medida se faz justa e necessária para observância ao arcabouço regulatório vigente, e retrata o tratamento leal, transparente e fidedigno que dispensa aos cotistas do Fundo e ao mercado em geral.

01/10/2020: comunica o fechamento do Fundo para aplicações e resgates, na forma do art. 39 da ICVM 555 e do Regulamento. O fechamento do Fundo, conforme ora noticiado, decorre de solicitação do gestor responsável pelos recursos do Fundo

mediante a anuência da Administradora, e visa, precipuamente, evitar a transferência de riquezas e prejuízos aos cotistas.

Assim, passará a vigorar de imediato, inclusive, abrangendo eventuais operações cuja previsão para liquidação se dê a partir desta data. A Administradora informa, por fim, que caso o Fundo permaneça fechado para aplicações e resgates por período superior a 5 (cinco) dias, convocará Assembleia Geral de Cotistas para deliberação entre uma das possibilidades previstas no §2º do art. 39 da ICVM 555, quais sejam: (i) substituição do administrador, do gestor ou de ambos; (ii) reabertura ou manutenção do fechamento do Fundo para resgates e aplicações; (iii) possibilidade do pagamento de resgate em ativos financeiros; (iv) cisão do Fundo; ou (v) liquidação do Fundo.

29/10/2020: comunica que, em Assembleia Geral Extraordinária de Cotistas iniciada às 15h30min do dia 19 de outubro de 2020 e continuada às 15h30min do dia 29 de outubro de 2020, deliberaram os cotistas pela manutenção do fechamento do Fundo para resgates e aplicações, de forma que, o Fundo continua fechado para novas movimentações, por período indeterminado.

30/12/2020: comunica que foi concluída, em 29 de dezembro de 2020, a incorporação do Infinity Institucional Fundo de Investimento Multimercado (CNPJ: 05.500.127/0001-93) pelo Fundo, conforme aprovado em Assembleia Geral de Cotistas, realizada em 04 de dezembro de 2020.

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.

Conforme a ata da Assembleia Geral Extraordinária (AGE) realizada em 04 de dezembro de 2020, os cotistas aprovaram a transferência da administração e da custódia do Fundo para a RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., inscrita no CNPJ sob o nº 42.066.258/0001-30.

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 637.293.736,31 (Seiscentos e trinta e sete milhões, duzentos e noventa e três mil, setecentos e trinta e seis reais e trinta e um centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por cotas de fundos de investimentos, sendo 99,69% do ITAÚ VERSO B RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 19.452.065/0001-04) e 0,33% do ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 11.419.818/0001-60), que serão devidamente apresentados a seguir.

Não há fatos relevantes publicados.

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

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.124.908.675,35.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos federais (87,80%), títulos privados (8,21%) e debêntures (3,83%), que representam o montante de 99,84% 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 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.

Na Assembleia Geral Ordinária e Extraordinária, realizada em 30 de julho de 2019, foi deliberado as alterações no regulamento do Fundo nos capítulos relativos às aplicações e aos resgates em dias sem expediente bancário, ao anexo I e outros aprimoramentos redacionais, com efetivação a partir de 30 de setembro de 2019.

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

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

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores

Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº 990, de 06 de julho de 1989.

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 25.328.963.377,97.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por operações compromissadas (70,36%) e títulos públicos federais (29,57%), que representam o montante de 99,93% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de maio de 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.

Na Assembleia Geral de Cotistas, realizada em 02 de setembro de 2019, deliberou alteração no regulamento nos capítulos relativos à adequação das resoluções 4.661 e 4.604, aplicação e resgates, outros aprimoramentos e consolidação do texto, com efetivação em 01 de novembro de 2019.

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.882.685.363,65 (Três bilhões, oitocentos e oitenta e dois milhões, seiscentos e oitenta e cinco mil, trezentos e sessenta e três reais e sessenta e cinco centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por cotas de fundos de investimentos, sendo 99,80% do ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 32.265.550/0001-29) e 0,20% do ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FUNDO DE INVESTIMENTO (CNPJ: 11.419.818/0001-60), que serão devidamente apresentados a seguir.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de agosto 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 dezembro de 2019, foi deliberada a alteração no Regulamento do Fundo nos capítulos relativos à remuneração, aplicações, resgates, adequação às Resoluções nº 4.661, de 25 de maio de 2019 e 4.604, de 19 de outubro de 2019 e outros aprimoramentos redacionais do Regulamento, sem a alteração das demais características do Fundo, com efetivação a partir de 26 de fevereiro de 2020.

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.875.353.477,03.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por operações compromissadas (51,97%) e títulos públicos federais (47,98%), que representam o montante de 99,95% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

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

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

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

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

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores

Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº 990, de 06 de julho de 1989.

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 25.328.963.377,97.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por operações compromissadas (70,36%) e títulos públicos federais (29,57%), que representam o montante de 99,93% do patrimônio do fundo.

Não há fatos relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de maio de 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.

Na Assembleia Geral de Cotistas, realizada em 02 de setembro de 2019, deliberou alteração no regulamento nos capítulos relativos à adequação das resoluções 4.661 e 4.604, aplicação e resgates, outros aprimoramentos e consolidação do texto, com efetivação em 01 de novembro de 2019.

SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 18.599.673/0001-75)

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

O FUNDO é administrado pelo Banco Santander (Brasil) S.A., (CNPJ: 90.400.888/0001-42), credenciado na CVM para a administração de carteiras conforme Ato Declaratório CVM nº 8.951, de 12 de setembro de 2006.

O FUNDO é gerido pela Santander Brasil Gestão de Recursos Ltda. (CNPJ: 10.231.177/0001-52), credenciada na CVM para a administração de carteiras conforme Ato Declaratório CVM nº 10.161, de 11 de dezembro de 2008.

Os serviços de custódia, tesouraria, controladoria e processamento dos Ativos Financeiros integrantes da Carteira do Fundo serão realizados pela Santander Securities Services Brasil DTVM S.A. (CNPJ: 62.318.407/0001-19) e credenciado na CVM para exercer a custódia de valores mobiliários conforme Ato Declaratório CVM nº 12.676, de 07 de novembro de 2012.

O fundo tem por objetivo investir em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa que busquem acompanhar as variações do Índice de Mercado ANBIMA – IMA-B 5.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.076.298.774,72 (Um bilhão, setenta e seis milhões, duzentos e noventa e oito mil, setecentos e setenta e quatro reais e setenta e dois centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por títulos públicos (99,77%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,23%).

Foi localizado um fato relevante, publicado em 06 de julho de 2017 (informando que o horário de movimentação do Fundo passará a ser até as 15:00 horas, a partir do dia 03/07/2017, inclusive, com as consequentes alterações necessárias no Formulário de Informações Complementares do Fundo.)

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

De acordo com Instrumento Particular de Alteração de Regulamento datado de 5 de fevereiro de 2020, foi deliberada a alteração da política de investimento do Fundo, passando a vigorar a partir de 6 de fevereiro de 2020.

XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP (CNPJ: 14.146.491/0001-98)

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 Intrag Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ: 62.418.140/0001-31), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM, conforme ato declaratório CVM nº 2.528, de 29 de julho de 1993.

O FUNDO é gerido pela XP Vista Asset Management Ltda. (CNPJ: 16.789.525/0001-98), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM, conforme Ato Declaratório nº 12.794, de 21 de janeiro de 2013.

Os serviços de custódia, tesouraria, controladoria serão realizados pelo Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores Mobiliários – CVM, conforme ato declaratório nº 1.524, de 23 de outubro de 1990.

O fundo tem por objetivo aplicar seus recursos em ativos financeiros que buscam acompanhar a variação do IPCA - Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo, divulgado pelo IBGE 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\$ 632.876.961,40 (Seiscentos e trinta e dois milhões, oitocentos e setenta e seis mil, novecentos e sessenta e um reais e quarenta centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: títulos públicos federais (52,99%), debêntures (35,21%), operações compromissadas em títulos públicos (5,77%), títulos privados (3,22%), valores a pagar ou receber (1,43%) e derivativos (1,39%).

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.

Quanto as assembleias que ocorreram no fundo de investimentos, listamos:

20/03/2020 - Assembleia Geral Extraordinária deliberou a alteração do gestor do Fundo para XP Vista Asset Management Ltda e deliberou a alteração no Regulamento do Fundo no capítulo relativo ao resgate, com efetivação a partir de 02/04/2020.

10/10/2019 - Assembleia Geral de Cotistas deliberou a alteração do administrador do Fundo de BNY Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. para Intrag Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. e deliberou a alteração no Regulamento do Fundo nos capítulos relativos aos prestadores de serviços, público alvo, política de investimento, remuneração, taxa de custódia, taxa de saída, emissão e resgate de cotas, aplicações e resgate em feriados e foro, com efetivação a partir do fechamento de 12/12/2019.

MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR (CNPJ: 12.138.813/0001-21)

Trata-se de um fundo de investimento em direitos creditórios, conforme regulamentação da ICVM 356, constituído sob a forma de condomínio fechado, cujo prazo máximo de duração é de 94 meses, contados da primeira data de subscrição, somados aos 32 meses contados a partir de dezembro de 2018, conforme assembleia geral de cotistas datada em 14 de novembro de 2018.

O Fundo não cobra taxas de ingresso ou de saída, mas a taxa de performance será paga imediatamente após o recebimento de cada pagamento pelo Fundo.

Quanto aos prestadores de serviço do Fundo, a GENIAL INVESTIMENTOS, inscrita no CNPJ de nº 27.652.684/0001-62 atua como Administradora e sob a Gestão da Brasil Plural, inscrita no CNPJ de nº 11.397.672/0002-80.

Quanto ao objetivo do Fundo, este é proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da aquisição de: (i) direitos de créditos que atendam aos critérios de elegibilidade e condições da cessão; (ii) ativos financeiros listados como moeda corrente nacional; títulos de emissão do Tesouro Nacional; operações compromissadas lastreadas em títulos públicos; quotas de fundos de investimento que sejam administrados por uma instituição autorizada e que invistam, pelo menos, 95% da sua carteira em títulos de emissão do Tesouro Nacional, além de serem remunerados com base na taxa DI ou na Taxa SELIC. Essa composição, busca superar o benchmark de CDI + 3,50% a.a.

Quanto ao patrimônio líquido do Fundo, tratam-se de direitos creditórios decorrentes de empréstimos e financiamentos concedidos pelo Banco BVA S.A., a seus clientes, representados pela cédula de crédito bancário (CCB). Os direitos de crédito são adquiridos de acordo com a política de investimento, isto é, por meio das aquisições acima mencionadas.

Em 01 de janeiro de 2010 a Administradora publicou um relatório acerca da classificação de risco do Fundo, que devido ao fato de estar em processo de encerramento, fica dispensado de ser avaliado por uma agência classificadora de riscos.

Em 19 de outubro de 2012 houve a intervenção pelo Banco Central no Banco BVA, que foi convertida em liquidação em 19 de julho de 2013, sendo decretada sua falência em 17 de setembro de 2014. Desta forma, os créditos que compõe as CCBs passaram a ser cobrados na esfera extrajudicial e/ou judicial e, em razão disso, dada as condições de crédito do emissor, a Administradora decidiu conceder e manter provisão de perdas em 100% dos recebíveis vencidos provenientes das CCBs.

Em 23 de outubro de 2013 foi criado um comitê para o Fundo, composto por representantes dos cotistas, a fim de analisar as propostas de negociação dos créditos junto aos devedores. As negociações passaram a considerar novos prazos, bem como a revisão do risco de crédito de cada devedor.

Já durante o segundo semestre de 2016, o Fundo provisionou 100% das CCBs que não receberam pagamentos e/ou não tiveram negociações no período, tendo em vista a deterioração da carteira com o aumento dos atrasos de pagamento.

Não foi disponibilizado, na CVM, quaisquer informações do andamento dos processos judiciais em curso por parte dos prestadores de serviços, visto que o Fundo é parte envolvida em processos cíveis de execução das garantias e cobranças de direitos creditórios.

Em julho de 2020, a S&P Global Ratings emitiu relatório de monitoramento de rating do fundo, cujo resultado fora publicado aderindo nota brAA (sf) para as cotas emitidas pelo fundo.

Por fim, dia 24 de novembro de 2020, foi alterado o artigo 23º do regulamento do Fundo, dizendo que o Fundo será administrado por uma nova administradora, a Genial Investimentos.

Quanto ao patrimônio do Fundo, em março de 2020 se mostrou no valor de R\$ 2.052.939,15 (Dois milhões, cinquenta e dois mil, novecentos e trinta e nove reais e quinze centavos).

AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES (CNPJ: 07.279.657/0001-89)

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

O fundo é administrado e gerido pela BEM – Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA. (CNPJ: 00.066.670/0001-00), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552, de 07 de dezembro de 2019.

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 812.622.043,38 (Oitocentos e doze milhões, seiscentos e vinte e dois mil, quarenta e três reais e trinta e oito centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: ações (92,9%), BDRs (3,84%), operações compromissadas em títulos públicos (2,25%) e valores a pagar ou receber (1%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

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

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

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 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].

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 CVM n.º 3067, de 06 de setembro de 1994, 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 setembro de 2001.

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), 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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.356.738.390,13 (Um bilhão, trezentos e cinquenta e seis milhões, setecentos e trinta e oito mil, trezentos e noventa reais e treze centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% de cotas de fundo de investimento, sendo o AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.403.884/0001-41), que será devidamente apresentado a seguir.

Em 05 de agosto de 2019, foi publicado Fato Relevante onde a administradora informa que, suspenderá novas aplicações no Fundo, por prazo indeterminado, no fechamento de 08 de agosto de 2019.

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 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 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 CVM n.º 3067, de 06 de setembro de 1994, 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 setembro de 2001.

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), 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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.917.361.908,11 (Um bilhão, novecentos e dezessete milhões, trezentos e sessenta e um mil, novecentos e oito reais e onze centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (82,64%), certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários (15,74%) e Operações Compromissadas (1,13%), que representam o montante de 99,51% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 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”.

AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES (CNPJ: 34.791.108/0001-61)

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

O fundo possui taxa de performance correspondente a 20% (vinte por cento) da valorização das cotas do fundo que exceder 100% (cem por cento) do [índice SMLL].

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 CVM n.º 3067, de 06 de setembro de 1994, 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 setembro de 2001.

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), 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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 556.827.248,63 (Quinhentos e cinquenta e seis milhões, oitocentos e vinte e sete mil, duzentos e quarenta e oito reais e sessenta e três centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 100% de cotas de fundo de investimento, sendo o AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.403.884/0001-41), que será devidamente apresentado a seguir.

Em 24 de agosto de 2020, foi publicado Fato Relevante onde a administradora informa que, suspenderá novas aplicações no Fundo, por prazo indeterminado, a partir de 25 de agosto de 2020.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 31 de agosto 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 30 de março de 2020 deliberou, a partir de 5 de maio de 2020, a alteração da denominação social do Fundo para AZ QUEST Small Mid Caps Institucional Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento de Ações, e a alteração do Regulamento do Fundo nos capítulos: a) Do Fundo; b) Do Público Alvo; c) Da Política de Investimento e Identificação dos Fatores de Risco; d) Da Administração e dos Prestadores de Serviços e; e) Da Tributação Aplicável.

- 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 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 CVM n.º 3067, de 06 de setembro de 1994, 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 setembro de 2001.

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), 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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.917.361.908,11.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (82,64%), certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários (15,74%) e Operações Compromissadas (1,13%), que representam o montante de 99,51% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 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”.

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\$ 476.437.296,22 (Quatrocentos e setenta e seis milhões, quatrocentos e trinta e sete mil, duzentos e noventa e seis reais e vinte e dois centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: ações (80,11%), operações compromissadas em títulos públicos (12,94%), valores a pagar ou receber (3,74%), investimentos no exterior (1,27%), debêntures (0,93%), BDRs (0,71%), outros ativos (0,22%), títulos públicos federais (0,05%) e derivativos (0,03%).

Foram localizados 3 fatos relevantes, publicados em 26 de abril de 2018, 05 de novembro de 2019 e 10 de setembro de 2020 (informando sobre 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 Investimento 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 do CMN nº 3.922/10 e (iv) e alteração do artigo 12º do Regulamento para adequação à CMN 3.922/10. Tais deliberações passaram a vigorar em 28 de outubro de 2019.

BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC 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, saída ou performance, cobradas pelo fundo.

O fundo é administrado pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 8695, de 20 de março de 2006, e 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.

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), devidamente credenciado junto à CVM, de acordo com o Ato Declaratório número 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo 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 (CNPJ: 17.009.959/0001-90), bem como em outros títulos e modalidades operacionais permitidas pela regulamentação em vigor.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.636.774.357,29 (Dois bilhões, seiscentos e trinta e seis milhões, setecentos e setenta e quatro mil, trezentos e cinquenta e sete reais e vinte e nove centavos).

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

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.

- BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 17.009.959/0001-90)

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 pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 8695, de 20 de março de 2006, e 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.

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), devidamente credenciado junto à CVM, de acordo com o Ato Declaratório número 7.204, de 25 de abril de 2003.

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. O Fundo também pode inclusive investir em ações de baixa liquidez e em operações com derivativos, envolvendo contratos referenciados em ações e índices de ações.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.637.154.377,57 (Dois bilhões, seiscentos e trinta e sete milhões, cento e cinquenta e quatro mil, trezentos e setenta e sete reais e cinquenta e sete centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (97,42%), valores a pagar ou receber (0,88%) e operações compromissadas em títulos públicos (1,7%).

Foi localizado um fato relevante, publicado em 19 de março de 2018 (comunicando que, nos termos do artigo 60 da Instrução da Comissão de Valores Mobiliários nº 555 de 17 de dezembro de 2014, observando o dever de fidúcia e no intuito de defender eventuais direitos dos cotistas, aderiu ao procedimento arbitral indenizatório proposto em face da Petróleo Brasileiro S.A – Petrobras, instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado – CAM B3.)

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

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

BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES (CNPJ: 09.290.813/0001-38)

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

O fundo é administrado pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 8695, de 20 de março de 2006, e 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.

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), devidamente credenciado junto à CVM, de acordo com o Ato Declaratório número 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo obter através de uma gestão a melhor seleção de ações que tem como meta a excelente distribuição de dividendos. Não há restrição a nenhum setor de atividade econômica na seleção de ações.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 111.432.252,33 (Cento e onze milhões, quatrocentos e trinta e dois mil, duzentos e cinquenta e dois reais e trinta e três centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta exclusivamente pelas cotas do BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 18.969.955/0001-17), que será detalhado adequadamente a seguir.

Não há fatos relevantes publicados.

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

Não há informações sobre 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.

- BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 18.969.955/0001-17)

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 pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 8695, de 20 de março de 2006, e 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.

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), devidamente credenciado junto à CVM, de acordo com o Ato Declaratório número 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo obter através de uma gestão a melhor seleção de ações que tem como meta a excelente distribuição de dividendos. Não há restrição a nenhum setor de atividade econômica na seleção de ações.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 111.421.794,12 (Cento e onze milhões, quatrocentos e vinte e um mil, setecentos e noventa e quatro reais e doze centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (86,25%), certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários (9,23%), operações compromissadas em títulos públicos (3,35%), ações e outros TVM cedidos em empréstimo (2,32%) e valores a pagar ou receber (2,26%).

Foi localizado um fato relevante, publicado em 19 de março de 2018 (comunicando que, nos termos do artigo 60 da Instrução da Comissão de Valores Mobiliários nº 555 de 17 de dezembro de 2014, observando o dever de fidúcia e no intuito de defender eventuais direitos dos cotistas, aderiu ao procedimento arbitral indenizatório proposto em face da Petróleo Brasileiro S.A – Petrobras, instaurado perante a Câmara de Arbitragem do Mercado – CAM B3.)

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

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

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

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 aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas do Caixa Vinci Valor Fundo de Investimento em Ações (CNPJ: 14.507.681/0001-93), administrado pela Administradora e gerido pela Gestora, que tem por objetivo buscar 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\$ 756.510.912,48 (Setecentos e cinquenta e seis milhões, quinhentos e dez mil, novecentos e doze reais e quarenta e oito centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta exclusivamente pelas cotas do Caixa Vinci Valor Fundo de Investimento em Ações (CNPJ: 14.507.681/0001-93), que será apresentado a seguir.

Foram localizados dois fatos relevantes, publicados em 12 de junho de 2017, informando a abertura do Fundo para novas aplicações a partir de 12 de junho de 2017 e retificando o Fato Relevante que informou a abertura do Fundo para novas aplicações a partir de 12 de junho de 2017, para esclarecer que a gestão da carteira do Fundo é exercida pela Vinci Equities Gestora de Recursos Ltda.

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

Não há informações sobre 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.

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

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 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 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\$ 767.882.100,70 (Setecentos e sessenta e sete milhões, oitocentos e oitenta e dois mil, cem reais e setenta centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (90,62%). Quanto aos demais ativos, identificamos exposição em: BDRs (5,35%), operações compromissadas em títulos públicos (2,08%), valores a pagar ou receber (1,82%) e outros ativos (0,13%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Não há informações sobre 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.

CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES (CNPJ: 11.182.064/0001-77)

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

O fundo possui taxa de performance, que correspondente a 20% (vinte por cento) da valorização das cotas do FUNDO que exceder 100% (cem por cento) do Ibovespa. Será provisionada diariamente, por dia útil, apurada semestralmente por períodos vencidos e calculada individualmente em relação a cada cotista. Não há cobrança de taxa de performance quando o valor da cota do fundo na data base respectiva for inferior ao valor da cota do fundo por ocasião da última cobrança da taxa de performance efetuada no fundo ou da aplicação do investidor no fundo se ocorrido após a data base de apuração.

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 3067, de 06 de setembro de 1994, e gerido pela CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA (CNPJ/MF: 10.626.543/0001-72), credenciada na CVM para a administração de carteiras conforme Ato Declaratório CVM nº 10.564, de 28 de agosto de 2009.

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/MF: 60.746.948/0001-12), e credenciado na CVM para exercer a custódia de valores mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº 1.432, de 27 de junho de 1990.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, rentabilidades 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\$ 1.217.691.164,96 (Um bilhão, duzentos e dezessete milhões, seiscentos e noventa e um, cento e sessenta e quatro reais e noventa e seis centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (98,01%), operações compromissadas em títulos públicos (2,23%) e títulos públicos federais (0,09%), que representam o montante de 100% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

O último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis é datado de 30 de setembro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis

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

Em Assembleia Geral de Cotistas de 07 de outubro de 2019, foram deliberados: (I) a substituição do antigo administrador do fundo do BNY Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A para a BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.; (II) a substituição do antigo prestador de serviços de controladoria, custódia e tesouraria do Fundo, para o Banco Bradesco S.A.; (III) a alteração da redação do público alvo do Fundo; (IV) alterações na política de investimento e nos limites de composição da carteira do Fundo; (V) a alteração da taxa máxima cobrada pelos serviços de custódia do Fundo passou de 0,036% (trinta e seis milésimos por cento ao ano) para 0,075% (setenta e cinco milésimos por cento ao ano); e (VI) alterações na redação do Regulamento do Fundo para adequá-los aos padrões do novo administrador. Tais deliberações entraram em vigor na abertura do dia 12 de novembro de 2019.

CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES (CNPJ: 14.550.994/0001-24)

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 315.811.586,46 (Trezentos e quinze milhões, oitocentos e onze mil, quinhentos e oitenta e seis reais e quarenta e seis centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: ações (97,64%), 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. Quanto aos demais ativos, identificamos exposição em: valores a pagar ou receber (1,35%), operações compromissadas em títulos públicos (0,65%) e BDRs (0,36%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

O Instrumento Particular de Alteração realizado em 03 de abril de 2020 deliberou, a partir dessa data, a atualização do endereço da Sede Social da Gestora, mencionada no capítulo “Da Administração e dos Prestadores de Serviço”.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 06 de dezembro de 2019 deliberou, a partir de 20 de janeiro de 2020, a alteração do regulamento do Fundo, nos capítulos “Do Fundo”, a fim de alterar sua denominação social de Constância Legan Brasil Fundo de Investimento em Ações para Constância Brasil Fundo de Investimento de Ações, “Da

Política de Investimento e Identificação dos Fatores de Risco” e “Da Emissão e do Resgate de Cotas”.

ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES (CNPJ: 34.546.979/0001-10)

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 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, e gerido pela Icatu Vanguarda Gestão de Recursos Ltda. (CNPJ: 68.622.174/0001-20), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 2.192, de 22 de outubro de 1992.

A custódia, tesouraria e controladoria dos ativos financeiros do FUNDO é 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 proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade por meio das oportunidades oferecidas pelo mercado de renda variável, investindo em companhias abertas com histórico consistente de distribuição de resultados por meio de pagamento de dividendos e/ou juros sobre o capital próprio ou com perspectiva de começar a distribuir resultados dentro de doze meses.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 315.811.586,46 (Trezentos e quinze milhões, oitocentos e onze mil, quinhentos e oitenta e seis reais e quarenta e seis centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por: ações (97,64%), 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. Quanto aos demais ativos, identificamos exposição em: valores a pagar ou receber (1,35%), operações compromissadas em títulos públicos (0,65%) e BDRs (0,36%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

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

ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES (CNPJ: 24.571.992/0001-75)

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

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado como Administrador de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo ato declaratório CVM nº 990 de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM por meio do ato declaratório para a prestação da atividade de custódia de ativos financeiros nº 1.524 de 23 de outubro de 1990.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.595.641.284,57 (Três bilhões, quinhentos e noventa e cinco milhões, seiscentos e quarenta e um mil, duzentos e oitenta e quatro reais e cinquenta e sete centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por cotas do Itaú Dunamis Master Fundo de Investimento em Ações (CNPJ: 18.138.837/0001-67) e do Itaú Caixa Ações - Fundo de Investimento (CNPJ: 07.096.546/0001-37), que serão detalhados adequadamente a seguir.

Foram localizados três fatos relevantes, publicados em 04 de outubro de 2019 (informando, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que fechará o Fundo para novas aplicações a partir do dia 07 de outubro de 2019.), em 29 de novembro de 2019 (informando, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 02 de dezembro de 2019) e em 06 de dezembro de 2019 (informando, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que fechará o Fundo para novas aplicações a partir do dia 09 de dezembro de 2019.)

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

- ITAÚ DUNAMIS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES (CNPJ: 18.138.837/0001-67)

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

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado como Administrador de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo ato declaratório CVM nº 990 de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM por meio do ato declaratório para a prestação da atividade de custódia de ativos financeiros nº 1.524 de 23 de outubro de 1990.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.359.163.323,49 (Quatro bilhões, trezentos e cinquenta e nove milhões, cento e sessenta e três mil, trezentos e vinte e três reais e quarenta e nove centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (81,4%), debêntures (8,85%), investimentos no exterior (8,28%), derivativos (0,64%), valores a pagar ou receber (0,47%), títulos públicos federais (0,34%) e outros ativos (0,01%).

Não há fatos relevantes publicados.

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

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

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

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

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado como Administrador de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo ato declaratório CVM nº 990 de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM por meio do ato declaratório para a prestação da atividade de custódia de ativos financeiros nº 1.524 de 23 de outubro de 1990.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 4.359.163.323,49 (Quatro bilhões, trezentos e cinquenta e nove milhões, cento e sessenta e três mil, trezentos e vinte e três reais e quarenta e nove centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por ações (48,09%), títulos públicos federais (31,01%), cotas de fundos de investimento (19,76%), BDRs (0,68%), debêntures (0,4%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,07%). As cotas não estão 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 outubro de 2020, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do fundo, não havendo opinião com ressalvas.

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

ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES (CNPJ: 23.731.629/0001-07)

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

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado como Administrador de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo ato declaratório CVM nº 990 de 06 de julho de 1989.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Itaú Unibanco S.A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM por meio do ato declaratório para a prestação da atividade de custódia de ativos financeiros nº 1.524 de 23 de outubro de 1990.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.462.115.658,32 (Um bilhão, quatrocentos e sessenta e dois milhões, cento e quinze mil, seiscentos e cinquenta e oito reais e trinta e dois centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: cotas de fundos, 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.

Foram localizados 14 fatos relevantes relacionados ao Fundo, publicados nas seguintes datas:

- 08/08/2019: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 09 de agosto de 2019. Informa ainda que, o Fundo será fechado para novas aplicações a partir do dia 10 de agosto de 2019;

- 29/08/2019: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações exclusivamente no dia 30 de agosto de 2019. Desta forma, o Fundo estará fechado para novas aplicações a partir do dia 02 de setembro de 2019;

- 18/09/2019: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 19 de setembro de 2019. Informamos ainda que, o Fundo será fechado para novas aplicações a partir do dia 24 de setembro de 2019;

- 26/11/2019: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que fechará o Fundo para novas aplicações a partir do dia 26 de novembro de 2019;
- 28/11/2019: informar, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações exclusivamente no dia 29 de novembro de 2019. Desta forma, o Fundo estará fechado para novas aplicações no dia 02 de dezembro de 2019;
- 09/01/2020: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações exclusivamente no dia 09 de janeiro de 2020. Desta forma, o Fundo estará fechado para novas aplicações no dia 10 de janeiro de 2020. Retificado no mesmo dia, informa e esclarece que fechará o Fundo para novas aplicações a partir do dia 14 de janeiro de 2020 e que esta decisão visa preservar a estratégia do Fundo;
- 03/03/2020: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 04 de março de 2020;
- 05/03/2020: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que fechará o Fundo para novas aplicações a partir do dia 05 de março de 2020;
- 16/06/2020: informar, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 17 de junho de 2020. Informa ainda que, o Fundo será fechado para novas aplicações a partir do dia 18 de junho de 2020;
- 18/06/2020: retifica o fechamento para captação informado no Fato Relevante publicado em 16 de junho de 2020;
- 19/06/2020: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que fechará o Fundo para novas aplicações a partir do dia 22 de junho de 2020;
- 29/07/2020: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 30 de julho de 2020;
- 31/07/2020: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que fechará o Fundo para novas aplicações a partir do dia 03 de agosto de 2020;
- 26/08/2020: informa, nos termos do artigo 60 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que abrirá o Fundo para novas aplicações a partir do dia 26 de agosto

de 2020. Informa ainda que, o Fundo será fechado para novas aplicações a partir do dia 27 de agosto de 2020.

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

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

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 2.241.283.487,34 (Dois bilhões, duzentos e quarenta e um milhões, duzentos e oitenta e três mil, quatrocentos e oitenta e sete reais e trinta e quatro centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: cotas de fundos, sendo 99,82% do Itaú Momento Ações (CNPJ: 10.263.612/0001-20) e 0,18% do Itaú Caixa Ações (CNPJ: 07.096.546/0001-37), que serão apresentados adequadamente a seguir.

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

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

Em Assembleia Geral Extraordinária ocorrida em 25/11/2019 foram deliberadas alterações no regulamento nos capítulos relativos à política de investimento, aplicação, resgates, limites por emissor e outros aprimoramentos, para refletir as alterações aprovadas na Assembleia, o qual passará a vigorar, a partir de 22/01/2020.

- ITAÚ MOMENTO AÇÕES (CNPJ: 10.263.612/0001-20)

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

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 3.668.058.358,57.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (77,66%), debêntures (10,46%), operações compromissadas em títulos públicos (5,96%), BDRs (4,63%), derivativos (1,28%) e títulos públicos federais (0,01%).

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

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

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

- ITAÚ CAIXA AÇÕES (CNPJ: 07.096.546/0001-37)

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

O fundo é administrado e gerido pelo Itaú Unibanco S.A (CNPJ: 60.701.190/0001-04), devidamente qualificado, autorizado e registrado perante a Comissão de Valores

Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 990, de 06 de julho de 1989.

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 285.253.122,33.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (48,09%), títulos públicos federais (31,01%), cotas de fundos de investimento (19,76%), BDRs (0,68%), debêntures (0,4%) e operações compromissadas em títulos públicos.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 12 de janeiro de 2018, informando que o Fundo aderiu a um procedimento arbitral de natureza indenizatória proposto em face da PETROBRAS – Petróleo Brasileiro S.A. perante a Câmara de Arbitragem do Mercado da B3.

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

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

META VALOR FI AÇÕES (CNPJ: 07.899.238/0001-40)

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 pelo Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552, de 07 de dezembro de 2019. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Banco Daycoval S.A.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 348.535.105,85 (Trezentos e quarenta e oito milhões, quinhentos e trinta e cinco mil, cento e cinco reais e oitenta e cinco centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (98,77%), valores a pagar ou receber (0,59%) e operações compromissadas em títulos públicos (0,43%) e outros ativos (0,21%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Conforme assembleia realizada dia 2 de janeiro de 2020 os cotistas deliberaram a transferência do administrador do Fundo da Daycoval Asset Management Administração de Recursos Ltda. para o Banco Daycoval S.A. a partir do fechamento do dia 6 de janeiro de 2020.

Conforme assembleia realizada dia 1 de novembro de 2019 os cotistas deliberaram: (I) transferência do administrador do Fundo da BNY Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. para a Daycoval Asset Management Administração de Recursos Ltda.; (II) a alteração do prestador de serviços de custódia do Fundo de BNY Mellon Banco S.A. pelo banco Daycoval S.A.; (III) alteração do auditor do fundo para Ernest & Young Auditores Independentes S.S.; (IV) a alteração da redação

do público alvo do Fundo; (V) alteração na política de investimento do Fundo; (VI) a alteração da taxa de administração do Fundo; (VII) a alteração da taxa de custódia; e (VIII) a alteração na regra de amortização e resgate de cotas do Fundo. Tais deliberações entraram em vigor no fechamento do dia 8 de dezembro de 2019.

Em ato do administrador, de 6 de maio de 2019, foi deliberada a alteração do prazo para pagamento de resgate de cotas do Fundo para o 2º dia útil contado da data de conversão de cotas para fins de resgate. O novo regulamento entrou em vigor em 27 de maio de 2019.

Em assembleia geral de cotistas, realizada em 20 de fevereiro de 2019, foram deliberadas alterações na política de investimento do Fundo. Tais deliberações entraram em vigor em 25 de março de 2019.

MULTINVEST FI AÇÕES (CNPJ: 13.608.335/0001-39)

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) da valorização da cota do fundo que exceder 100% (cem por cento) do Ibovespa (taxa de performance).

O fundo é administrado pelo Banco Daycoval S.A (CNPJ: 62.232.889/0001-90), devidamente registrado como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552 de 05 de dezembro de 2019, e gerido pela Meta Asset Management Ltda. (CNPJ: 06.088.907/0001-30), credenciada na CVM por meio do Ato Declaratório nº 7.694, de 24 de março de 2004.

O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira do fundo é o Banco Daycoval S.A., credenciada na CVM, por meio do Ato Declaratório nº 1.085, de 30 de agosto de 1989.

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas, no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em 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.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 105.751.255,68 (Cento e cinco milhões, setecentos e cinquenta e um mil, duzentos e cinquenta e cinco reais e sessenta e oito centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (89,44%), operações compromissadas em títulos públicos (3,85%), BDRs (3,18%), títulos públicos federais (2,33%), valores a pagar ou receber (1,12%), derivativos (0,05%) e outros ativos (0,02%).

Em 12 de março de 2019, a administradora do fundo deu publicidade ao Fato Relevante informando que o Administrador renunciou, na data apresentada, aos serviços de administração fiduciária do Fundo, nos termos do art. 94, caput e §1º, da Instrução CVM 555. Em razão da renúncia do Administrador, serve o presente fato relevante para informar, ademais, e nos termos do já referido dispositivo, que o Administrador: (I) permanecerá no exercício de suas funções até sua efetiva substituição, a qual, contudo, deve ocorrer no prazo máximo de 30 (trinta) dias; e (II) que vai convocar Assembleia Geral Extraordinária de Cotistas a ser realizada no dia 29 de março de 2019 para, dentre outros assuntos, deliberar pela substituição do Administrador do Fundo mediante proposta a ser apresentada pelo Gestor do Fundo na referida Assembleia Geral Extraordinária.

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

Em Assembleia Geral, realizada em 29 de março de 2019, foram deliberados os seguintes assuntos: I) A transferência da administração fiduciária do Fundo do Atual Administrador para Nova Administradora mediante proposta a ser apresentada pelo Gestor do Fundo na Assembleia; II) Os procedimentos de transferência da Administração do Fundo, caso seja apresentada proposta de Novo Administrador pelo Gestor do Fundo e o item I acima seja aprovado; III) a contratação de serviço de auditoria do Fundo para o período compreendido entre o seu último Balanço Patrimonial Data de Transferência, caso aprovado o item I acima; IV) indicação do diretor estatutário da Nova Administradora que responderá pelas obrigações do Fundo perante a CVM, a partir da Data da Transferência, pela administração do Fundo; V) a indicação do diretor estatutário da Nova Administradora que responderá pelas obrigações do Fundo perante a Receita Federal do Brasil, a partir da Data da Transferência da administração do Fundo; VI) a destituição do Atual Administrador da função de distribuidor de cotas do Fundo e a contratação da Nova Administradora do Fundo, caso seja aprovado o item (i) acima para o desempenho desta função; VII) a ratificação do prestador de serviços de gestão; VIII) a destituição do atual prestador de serviços de Custódia, Tesouraria, Escrituração e Controle de Ativos e de Passivos do Fundo e a contratação de novo custodiante para o desempenho desta; IX) o novo Regulamento consolidado, no padrão da Nova Administradora, caso seja apresentada e aprovada proposta de nova administradora pelo Gestor do Fundo; X) a autorização para que a Nova Administradora realize todos os procedimentos necessários, caso aprovados os itens acima.

Conforme Instrumento particular de alteração datado de 04 de maio de 2020, foram deliberados os seguintes assuntos: Reduzir a taxa de custódia para 0,00% a.a. (zero vírgula zero por cento ao ano). O novo regulamento passou a vigor a partir de 04 de maio de 2020.

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.

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\$ 1.060.739.165,08 (Um bilhão, sessenta milhões, setecentos e trinta e nove mil, cento e sessenta e cinco reais e oito centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por 99,92% do fundo de investimento OCCAM FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (CNPJ: 11.616.482/0001-25), que será devidamente apresentado a seguir. Quanto aos demais ativos, estão distribuídos em 0,42% de operações compromissadas

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de abril de 2019 deliberou, a partir de 24 de abril de 2019: a) a substituição do antigo administrador do Fundo, BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. para BEM DTVM Ltda.; b) A substituição do prestador dos serviços de custódia, controladoria e tesouraria do Fundo para Banco Bradesco S.A.; c) Substituição do prestador de serviços de distribuição, agenciamento e colocação de

cotas do Fundo pelo Genial Institucional CCTVM S.A; d) Manutenção do atual prestador de serviços de administração da carteira (gestão) do Fundo, qual seja, a Occam Brasil Gestão de Recursos Ltda.; e) Manutenção dos prestadores de serviço de auditoria do Fundo; f) Manutenção da denominação social do Fundo; g) Alteração do foro do Fundo para Cidade de Deus; h) Exclusão das menções ao BNY Mellon, seus meios de contato e endereço, para inserção da nova Administradora; i) Consolidação do texto do regulamento do Fundo para refletir as alterações descritas.

O Instrumento Particular de Alteração realizado em 22 de maio de 2019 deliberou, a partir de 27 de maio de 2019, a adaptação do prazo de pagamento de resgates aos cotistas do Fundo, o qual foi reduzido em 1 dia.

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

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

- 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.

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\$ 1.162.072.109,98.

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (93,05%), operações compromissadas (5,62%) e Brazilian Depositary Receipts (1,09%), que representam o montante de 99,76% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 11 de abril de 2019 deliberou a partir de 25 de abril de 2019 a substituição do antigo administrador do Fundo, Bny Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A., pela BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.; substituição do antigo prestador dos serviços de custódia, controladoria e tesouraria do Fundo pelo Banco Bradesco S.A.; e deliberou a partir de 14 de maio de 2019, a alteração da denominação social do Fundo de “Occam Fundo de Investimento de Ações” para “Occam Fundo de Investimento em Ações”; e alterações em: política de investimento e objetivo do Fundo, fatores de risco, taxa máxima de custódia e de administração, capítulo que trata dos encargos do Fundo, emissão e resgate de cotas e demais alterações necessárias aos padrões da nova administradora.

QUELUZ VALOR FI AÇÕES (CNPJ: 09.289.072/0001-75)

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

O fundo é administrado e gerido pelo Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552, de 07 de dezembro de 2019. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Banco Daycoval S.A.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 126.804.718,84 (Cento e vinte e oito milhões, oitocentos e quatro mil, setecentos e dezoito reais e oitenta e quatro centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (93,25%), operações compromissadas em títulos públicos (5,61%), BDRs (0,66%) e valores a pagar ou receber (0,47%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 15 de julho de 2019 deliberou, a partir de 03 de setembro de 2019, a alteração do Regulamento do Fundo, nos capítulos “Da Política de Investimento e Identificação dos Fatores de Risco”, “Da Administração e dos Prestadores de Serviço” e “Da Emissão e do Resgate de Cotas”.

SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES (CNPJ: 11.458.144/0001-02)

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

O fundo é administrado 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 Sul América Investimentos Gestora de Recursos S.A (CNPJ: 21.813.291/0001-07), credenciada pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 14.182, de 14 de abril de 2015.

A custódia, tesouraria e controladoria dos ativos financeiros do Fundo é 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 proporcionar aos seus cotistas, rentabilidade destacada através dos investimentos em ações de companhias abertas com potencial de valorização e perspectiva de retorno médio / longo prazo, correspondente a 100% do Ibovespa.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 1.012.301.864,05 (Um bilhão, doze milhões, trezentos e um mil, oitocentos e sessenta e quatro reais e cinco centavos).

Foram localizados três fatos relevantes, publicados em:

- 19/04/2018: Informa que, no exercício do seu dever de diligência e fidúcia e no intuito de prevenir e resguardar eventuais direitos, o FUNDO aderiu ao Procedimento Arbitral de cunho indenizatório em face de Petróleo Brasileiro S.A. – PETROBRAS, instaurado junto à Câmara de Arbitragem do Mercado (CAM – B3);
- 26/02/2020: comunica, nos termos do Artigo 19 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que a partir do dia 19 de março de 2020 inclusive, ou do fechamento do dia em que o Patrimônio Líquido do Fundo superar o montante de R\$ 1.400.000.000,00 (um bilhão e quatrocentos milhões de reais), o que ocorrer primeiro, suspenderá o Fundo para novas aplicações por prazo indeterminado;
- 19/03/2020: comunica, nos termos do Artigo 19 da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, que o Fundo abrirá para novas aplicações por prazo indeterminado a partir do dia 19 de março de 2020, inclusive.

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.

O Instrumento Particular realizado em 23 de maio de 2019 deliberou, a partir de 27 de maio de 2019, a adaptação do prazo de pagamento de resgates aos cotistas do Fundo, o qual foi reduzido em 1 dia.

A Assembleia Geral de Cotistas realizada em 25 de fevereiro de 2019 deliberou, a partir do fechamento de 25 de fevereiro de 2019, sobre a: substituição da instituição administradora do Fundo, a Sul América Investimentos Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A., para BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (“Nova Administradora”), bem como a deliberação sobre as condições operacionais para tal substituição.

AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO (CNPJ: 09.141.893/0001-60)

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

O fundo é administrado pela BNY MELLON Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 02.201.501/0001-61), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 4.620, de 19 de dezembro de 1997, e gerido pela AZ QUEST Investimentos Ltda. (CNPJ: 04.506.394/0001-05), credenciada pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 6.435, 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 será o BNY MELLON BANCO S.A. (CNPJ: 42.272.526/0001-70), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório 12.605, de 26 de setembro de 2012.

O fundo tem por objetivo de investimento A política de investimento do FUNDO consiste em aplicar, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seu patrimônio líquido em cotas do AZ QUEST MASTER EQUITY HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO, inscrito no CNPJ sob o nº 13.812.152/0001-30 (“Fundo Master”), gerido pela GESTORA, cuja política de investimento consiste em proporcionar ganhos de capital a longo prazo a seus cotistas, buscando obter máxima rentabilidade e privilegiando retornos superiores ao CDI, através de uma gestão ativa e da diversificação de sua carteira. Através da análise dos cenários macroeconômicos nacionais e internacionais, dos riscos de mercado, de crédito e liquidez, são definidas, pela ADMINISTRADORA, as estratégias e a seleção de ativos do Fundo Master, respeitando-se sempre a legislação, as normas e regulamentos aplicáveis, bem como as diretrizes estabelecidas no regulamento do Fundo Master.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 181.234.281,22 (Cento e oitenta e um milhões, duzentos e trinta e quatro mil, duzentos e oitenta e um reais e vinte e dois centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por AZ QUEST MASTER EQUITY HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (CNPJ: 13.812.152/0001-30).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Em Assembleia Geral de Cotistas de 28 de setembro de 2018, foram deliberadas: (i) a alteração na política de investimento do Fundo; e (ii) a alteração na taxa de custódia do Fundo. Tais deliberações entraram em vigor em 1º de novembro de 2018.

- AZ QUEST MASTER EQUITY HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (CNPJ: 13.812.152/0001-30)

Trata-se de um fundo de investimentos classificado como de investimento multimercado, 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 BNY MELLON Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 02.201.501/0001-61), credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 4.620, de 19 de dezembro de 1997, e gerido pela AZ QUEST Investimentos Ltda. (CNPJ: 04.506.394/0001-05), credenciada pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório nº 6.435, 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 será o BNY MELLON BANCO S.A. (CNPJ: 42.272.526/0001-70), credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM pelo Ato Declaratório 12.605, de 26 de setembro de 2012.

O fundo tem por objetivo proporcionar ganhos de capital a longo prazo a seus cotistas, buscando obter máxima rentabilidade e privilegiando retornos superiores ao CDI, através de uma gestão ativa e da diversificação de sua carteira.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 181.204.914,45

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por ações (44,30%), títulos públicos federais (39,30%), operações compromissadas (15,13%), Brazilian Depositary Receipts (0,54%) e debêntures (0,01), que representam o montante de 99,28% do patrimônio do fundo.

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Em Assembleia Geral de Cotistas, de 10 de janeiro de 2019, foi deliberada a renegociação da taxa de custódia do Fundo, conforme descrito na Nota Explicativa nº 8.c. Tal deliberação entrou em vigor em 16 de janeiro de 2019.

Em Assembleia Geral de Cotistas, de 28 de setembro de 2018, foram deliberadas: (i) a alteração da data de conversão de cotas para fins de resgate do Fundo, conforme descrito na Nota Explicativa nº 7; (ii) a inclusão da alteração da taxa máxima de custódia como uma das deliberações eficazes, no mínimo, a partir de trinta dias ou do prazo para pagamento de resgate, o que for maior; e (iii) alterações na política de investimento do Fundo. Tais deliberações entraram em vigor em 1º de novembro de 2018.

Em Assembleia Geral de Cotistas, de 24 de julho de 2020, foram deliberadas: (i) a alteração da Gestora do Fundo; (ii) a alteração do prestador de serviços de custódia do Fundo; (iii) a alteração na política de investimento do Fundo; e (iii) a alteração na taxa máxima de custódia do Fundo. Tais deliberações entraram em vigor em 28 de agosto de 2020.

BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.597/0001-70)

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

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

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 74.547.462,29 (Setenta e quatro milhões, quinhentos e quarenta e sete mil, quatrocentos e sessenta e dois reais e vinte e nove centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência, é composta por títulos públicos federais (53,92%), valores a pagar ou receber (21,91%), operações compromissadas em títulos públicos (13,17%), investimentos no exterior (10,95%) e derivativos (0,13%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Não há informações sobre 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.

MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO (CNPJ: 27.746.867/0001-47)

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

O fundo é administrado e gerido pelo Banco Daycoval S.A. (CNPJ: 62.232.889/0001-90), devidamente registrado como prestador de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 17.552, de 07 de dezembro de 2019. O responsável pelos serviços de registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira também será o Banco Daycoval S.A.

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

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 32.858.481,05 (Trinta e dois milhões, oitocentos e cinquenta e oito mil, quatrocentos e oitenta e um reais e cinco centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: títulos públicos federais (42,82%), ações (28,75%), operações compromissadas em títulos públicos (15,45%), valores a pagar ou receber (12,62%), derivativos (0,16%), BDRs (0,11%), debêntures (0,06%) e outros ativos (0,03%).

Não há Fatos Relevantes publicados.

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

Conforme assembleia geral de cotistas realizada em 26 de agosto de 2019, foi deliberado e aprovado: (I) Substituição da administradora pela Daycoval Asset Management Administração de Recursos Ltda.; e (II) Alteração do prestador de serviço de custódia, controladoria e escrituração pelo Banco Daycoval S.A. Tais deliberações entraram em vigor no fechamento das operações de 30/08/2019.

Conforme assembleia geral de cotistas realizada em 22 de outubro de 2019, foi deliberado e aprovado: (I) Alteração da taxa de administração, de 1,00% (um por cento) para 1,50% (um e meio por cento); (II) Alteração do prazo de cotização para D+5; e (III) Vedação ao investimento em ativo de crédito privado.

Conforme assembleia geral de cotistas realizada em 27 de dezembro de 2019, foi deliberado e aprovado: (I) Substituição da administradora pelo Banco Daycoval S.A.; e (II) Complementação da redação do item 6.1 do regulamento do Fundo, a fim de ratificar que o Fundo busca obter retornos superiores ao CDI (Certificado de Depósito Interfinanceiro).

BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP (CNPJ: 35.640.811/0001-31)

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 pela BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM (CNPJ: 59.281.253/0001-23), credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 8695, de 20 de março de 2006, e 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.

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), devidamente credenciado junto à CVM, de acordo com o Ato Declaratório número 7.204, de 25 de abril de 2003.

O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus Cotistas a valorização de suas Cotas no médio e longo prazos, decorrentes dos investimentos pelo Fundo em Valores Mobiliários de emissão de Sociedades Alvo.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 361.122.940,75 (Trezentos e sessenta e um milhões, cento e vinte e dois mil, novecentos e quarenta reais e setenta e cinco centavos).

Não foi possível localizar a carteira de investimentos do fundo para o mês de referência.

Foi localizado um fato relevante, publicado em 27 de outubro de 2020 informando que, nos termos do Parágrafo Segundo do Artigo 37º do regulamento do Fundo (“Regulamento”), o qual prevê que, após a Primeira Oferta, novas emissões de Cotas podem ocorrer mediante simples deliberação do Administrador, conforme instruções do gestor e a seu exclusivo critério, desde que limitado ao Capital Autorizado para emissão de cotas, sem necessidade de aprovação em Assembleia Geral de Cotistas, o Administrador deliberou por meio do Instrumento Particular de Alteração do Fundo de Investimento do BTG Pactual Economia Real Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia (“Instrumento de Alteração”) datado de 27 de outubro de 2020 a 2ª (segunda) emissão e oferta pública de Cotas do Fundo no rito da Instrução CVM nº 400, de 29 de dezembro de 2003, conforme alterada (“Instrução CVM nº 400”) e da Instrução CVM nº 578, de 30 de agosto de 2016, conforme alterada, (“Instrução CVM nº 578” e “Oferta” respectivamente).

Será garantido aos Cotistas que não sejam Cotistas Inadimplentes (conforme definido no Regulamento do Fundo) o direito de preferência, total ou parcial, na subscrição das novas Cotas, na proporção máxima da respectiva participação de cada Cotista no patrimônio líquido do Fundo, a ser exercido durante o período de 10 (dez) dias corridos,

contados da data de publicação do anúncio de início desta nova emissão de Novas Cotas (“Direito de Preferência”).

Não foi possível localizar o último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas, a posição patrimonial e financeira do fundo.

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.

LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP (CNPJ: 16.685.929/0001-31)

Trata-se de um fundo de investimentos em participações, constituído sob a forma de condomínio fechado e com prazo de duração de 14 (quatorze) anos, contado da data da primeira emissão de cotas do Fundo.

O Fundo é administrado pelo Banco Daycoval S.A., inscrito no CNPJ sob o nº 62.232.889/0001-90, sob a Gestão da LEGATUS GESTORA DE RECURSOS LTDA., inscrita no CNPJ sob o nº 20.445.967/0001-94. O objetivo do Fundo é buscar, no longo prazo, a valorização do capital investido, por meio da aquisição de ações, debêntures, bônus de subscrição, ou outros títulos e valores mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações de emissão de companhias, abertas ou fechadas, que atuem no segmento imobiliário que tenham por objetivo principal, direta ou indiretamente, o desenvolvimento de atividades relacionadas à exploração de shopping centers, centros de convenções, conglomerados de lojas/imóveis comerciais, outros ativos do segmento imobiliário comercial, bem como à aquisição, locação de terrenos, participação em licitações, bem com outras formas permitidas por lei, para a construção de tal classe de ativos imobiliários, podendo ainda realizar a negociação de suas unidades/lojas, participando do processo decisório, com efetiva influência na definição de sua política estratégica.

O Gestor receberá, ainda, Taxa de Performance auferida em virtude dos resultados obtidos pelo Fundo, correspondente a 20% (vinte por cento) dos valores distribuídos aos Cotistas, que excederem os valores integralizados, devidamente atualizados pela taxa anual de 8% (oito por cento) e corrigido anualmente pelo ("Benchmark"), desde a data da integralização de Cotas até a data de liquidação do Fundo ("Taxa de Performance") calculada com duas casas decimais sem arredondamento, conforme art. 12 do regulamento do Fundo.

Conforme dados publicados no site da CVM, a última atualização do Fundo no site do Órgão Competente foi no mês de junho de 2020, o patrimônio líquido do Fundo é de R\$ 245.784.872,00 (duzentos e quarenta e cinco milhões, setecentos e oitenta e quatro mil, oitocentos e setenta e dois reais). 37 O referido patrimônio contempla, em sua totalidade (100%), ações do emissor LA SHOPPING CENTERS AS (RSHC3).

Em 24 de setembro de 2018, a Administradora do Fundo tratou de publicar um fato relevante destinado aos cotistas do Fundo e ao mercado, em cumprimento ao ofício nº 60/2018/CVM/SIN/GIES, que tendo a CVM entendido que em 31 de dezembro de 2017 o Fundo não se qualificava como entidade de investimento, nos termos da instrução CVM nº 579/16, o Administrador tomou, nos termos do ofício, as seguintes medidas: (a) Reelaborou e reapresentou as Demonstrações Financeiras do Fundo correspondentes ao exercício social encerrado em 31 de dezembro de 2017, devidamente refeitas, de forma que a sociedade investida foi avaliada nos termos do art. 8º da Instrução CVM 576/16.

As referidas Demonstrações Financeiras foram devidamente auditadas e disponibilizadas aos cotistas para aprovação em assembleia geral ordinária convocada para o dia 01/10/2018; e (b) Reenviou, via CVMweb, os informes trimestrais do Fundo referentes a Set/17, Dez/17, Mar/18 e Jun/18 de forma a apresentar o novo patrimônio líquido do Fundo, considerando o item (a) acima, e divulgando que o Fundo não se qualificava, nas respectivas datas-base, como entidade de investimento.

O referido Fato relevante tem por objetivo informar (i) sobre as exigências do Ofício; (ii) que o Fundo não se qualificava como entidade de investimento em 31.12.2017; e (iii) sobre a consequente reavaliação do patrimônio líquido do Fundo e reapresentação dos informes do respectivo período.

Fazendo parte destas atualizações, a Administradora ainda informa que no entendimento da CVM, a previsão de comitê de investimento com participação de cotista não ligado ao Administrador e à Legatus e poderes de ingerência na gestão da sociedade investida, impedia a qualificação do Fundo como entidade de investimento.

Nesse sentido, em assembleia geral realizada em 21/09/2018 os cotistas aprovaram a extinção e exclusão do referido Comitê de Investimentos, passando as decisões de gestão, incluindo exclusão do referido Comitê de Investimentos, passando as decisões de gestão, incluindo investimentos e desinvestimentos, para competência exclusiva e discricionária do Administrador e da Legatus, na qualidade de cogestores.

Diante dessa alteração, e a partir da respectiva data, o Fundo passou a ser classificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação aplicável, voltando sua carteira a ser contabilizada com base no valor justo dos ativos, nos termos da Instrução CVM nº 579/16. Tendo em vista que o Fundo voltou a ser classificado como entidade de investimento a partir de 21/09/2018, os efeitos da reelaboração das demonstrações financeiras do Fundo relativas ao período mencionado no Ofício já foram devidamente ajustados, não tendo havido prejuízo aos cotistas. Pelo contrário, o reprocessamento da carteira do Fundo pelo método da equivalência patrimonial no período mencionado resultou em um patrimônio líquido de aproximadamente R\$ 195 milhões, valor este superior ao patrimônio líquido anterior ao reprocessamento e reenquadramento.

Em 01 de julho de 2020, em fatos relevantes, o administrador informou que os ativos do Fundo, os quais são reconhecidos por seu valor justo, serão remarcados na data base de 30 de junho 2020, em conformidade com o exposto abaixo. O Administrador contratou a empresa de avaliação JLL – Jones Lang LaSalle (“JLL”), para que de acordo com os seus critérios, metodologias e premissas, realizasse a avaliação do valor justo dos ativos integrantes da carteira do Fundo. Diante do momento de crise global vivido pelo impacto da pandemia do COVID 19 e seus riscos para o desenvolvimento de novos projetos, foi requerido à JLL, que considerasse tal impacto nos ativos em operação e nos ativos considerados como em desenvolvimento. O Boulevard Shopping Brasília completou seus primeiros dez anos de operação, cuja performance está em consonância com os objetivos planejados.

O Praça das Dunas Shopping Center, projeto adquirido em 2018 teve suas obras iniciadas e as primeiras lojas comercializadas, dentro do cronograma definido pela companhia, o que justifica a valorização do empreendimento, que é bastante promissor, e, será de grande relevância na composição do patrimônio do fundo.

Destacamos que o LA Pampulha Empreendimentos Imobiliários S.A. (“LA Pampulha”), foi negativamente impactado em decorrência do procedimento arbitral promovido pelo proprietário do imóvel (“Proprietário”). Referida arbitragem versa sobre a rescisão, a pedido do Proprietário, do respectivo Contrato de Locação de Espaço Não Residencial, com Assunção de Obrigação de Reforma e Construção Parcial e Outras Avenças firmado 06 de julho de 2007, cujo objeto é o desenvolvimento e exploração de um shopping center no imóvel, localizado no Bairro da Pampulha, em Belo Horizonte/MG.

A LA Pampulha contratou o escritório jurídico Forbes, Kozan e Gasparetti Advogados para atuação na defesa de seus interesses. Verificamos, também, que a 2008 Empreendimentos Comerciais S.A. (“2008 Empreendimentos”), em processo arbitral, trata de revisional do valor do aluguel pago pelo empreendimento, qual seja R\$ 591.704,29. O proprietário do imóvel pleiteia o reajuste do valor pago à título de aluguel para R\$ 908.000,00 e em reconvenção, a 2008 Empreendimentos pleiteia o reajuste para valores inferiores a R\$ 400.000,00 (quatrocentos mil reais). Tal impacto ainda não foi refletido na avaliação do valor justo da companhia em razão do procedimento arbitral estar em curso.

BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 (CNPJ: 20.716.161/0001-93)

O FUNDO terá prazo de duração de 10 (dez) anos, contados a partir da data da primeira integralização de cotas do FUNDO (“Data de Início”), sem prejuízo de poder ser liquidado antecipadamente, nos termos deste Regulamento.

O fundo é administrado 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, e gerido pela Rio Bravo Investimentos Ltda. (CNPJ: 03.864.607/0001-08), sociedade devidamente autorizada pela CVM para o exercício profissional de administração de carteira de títulos e valores mobiliários, por meio do Ato Declaratório n.º 6.051, de 27 de julho de 2000.

O fundo tem por objetivo realizar investimentos imobiliários, objetivando, fundamentalmente, auferir ganhos decorrentes da rentabilidade dos Ativos Imobiliários, a aquisição e/ou alienação dos Ativos Imobiliários pelo Fundo observará os termos e condições estabelecidos na legislação e regulamentação vigentes e as disposições contidas no Regulamento.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 64.214.146,47 (Sessenta e quatro milhões, duzentos e quatorze mil, cento e quarenta e seis reais e quarenta e sete centavos).

Não foi possível localizar a carteira de investimentos do fundo para o mês de referência.

Não foi possível localizar o último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas, a posição patrimonial e financeira do fundo.

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.

BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 (CNPJ: 13.584.584/0001-31)

O FUNDO terá prazo de duração de 10 (dez) anos, contados a partir da data da primeira integralização de cotas do FUNDO (“Data de Início”), sem prejuízo de poder ser liquidado antecipadamente, nos termos deste Regulamento.

O Fundo é administrado e representado pela Oliveira Trust Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ: 36.113.876/0001-91), devidamente autorizada pela CVM para a prestação dos serviços de administração de carteira de títulos e valores mobiliários através do Ato Declaratório nº 6.696, expedido em 21 de fevereiro de 2002.

O gestor da carteira do Fundo será a H11 GESTÃO DE RECURSOS LTDA. (CNPJ: 97.543.940/0001-69), devidamente credenciada na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM nº 12.007, de 3 de novembro de 2011.

O fundo tem por objetivo a aquisição de ativos previstos no art. 45 da Instrução CVM 472, ou seja (a) aquisição de imóveis e direitos reais sobre imóveis, construídos ou em fase de retrofit; (b) desde que a emissão ou negociação tenha sido objeto de registro ou de autorização pela CVM, ações, debentures, bônus de subscrição, seus cupons, direitos, recibos de subscrição e certificados de desdobramentos, certificados de depósito de valores mobiliários, cédulas de debentures, cotas de fundos de investimentos, notas promissórias, e quaisquer outros valores mobiliários, desde que se trate de emissores cujas atividades preponderantes sejam permitidas aos FII; (c) ações ou cotas de sociedades cujo único propósito se enquadre entre as atividades permitidas aos FIIs; (d) cotas de fundos de investimento em participações (FIP) que tenham como política de investimento, exclusivamente, atividades permitidas aos FII ou de fundos de investimento em ações que sejam setoriais e que invistam exclusivamente em construção civil ou no mercado imobiliário; (e) certificados de potencial adicional de construção emitidos com base na Instrução CVM nº 401 de 29 de dezembro de 2003, (f) cotas de outros FIIs; (g) certificados de recebíveis imobiliários e cotas de fundos de investimento em direitos creditórios (FDIC) que tenham como política de investimento, exclusivamente, atividades permitidas aos FII e desde que a sua emissão ou negociação tenha sido registrada na CVM; (g) letras hipotecárias; (h) letras de crédito de imobiliário; e (i) outros ativos permitidos de investimento aos FII nos termos da Instrução CVM 472.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 249.224.558,74 (Duzentos e quarenta e nove milhões, duzentos e vinte e quatro mil, quinhentos e cinquenta e oito reais e setenta e quatro centavos).

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: ações (73,67%), outros ativos (25,8%) e valores a pagar ou receber (0,53%).

Não foi possível localizar o último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas, a posição patrimonial e financeira do fundo.

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.

VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 (CNPJ: 13.842.683/0001-76)

O Fundo é constituído de acordo com o disposto na Lei nº 8.668/1993 e na Instrução CVM 472/08, sob a forma de condomínio fechado, regido pelo presente Regulamento e pelas disposições legais que lhe forem aplicáveis e destina-se a investidores qualificados, assim entendidos as pessoas naturais ou jurídicas, brasileiras ou estrangeiras, que se enquadrem no conceito de investidor qualificado, nos termos do artigo 9º-B e 9-C da Instrução CVM 539/15 (“Cotistas Qualificados”).

O Fundo tem prazo de duração indeterminado. As Cotas A terão prioridade no reembolso de seu valor, o que deverá acontecer até o 79º (septuagésimo nono) mês contado a partir da concessão do registro de funcionamento do FUNDO. As Cotas B terão o reembolso de seu valor até o 107º (centésimo sétimo) mês contado a partir da concessão do registro de funcionamento do Fundo.

O Fundo é administrado e representado pela Planner Corretora de Valores S.A. (CNPJ: 00.806.535/0001-54), devidamente credenciada pela CVM por meio do Ato Declaratório nº 3.585, de 02 de outubro de 1995.

A carteira do Fundo será gerida conjuntamente pela Vector Administração de Recursos Financeiros Ltda. (CNPJ: 07.806.377/0001-81), devidamente autorizada pela CVM a exercer a atividade de administração de recursos de terceiros por meio do Ato Declaratório CVM nº 8.700, de 24 de março de 2006 e Queluz Gestão de Recursos Financeiros Ltda. (CNPJ: 07.250.864/0001-00), devidamente autorizada pela CVM a exercer a atividade de administração de recursos de terceiros por meio do Ato Declaratório CVM nº 8279, de 12 de abril de 2005.

O fundo tem por objeto a realização de investimentos imobiliários, consoante sua política de investimentos e, preferencialmente, por meio da aquisição de Empreendimentos Imobiliários Prontos, inclusive bens e direitos a eles relacionados, predominantemente lajes corporativas e escritórios comerciais de alto padrão, visando gerar ganhos por meio de locação e/ou arrendamento e alienação, se beneficiar de potencial valorização imobiliária, nos termos da política de investimentos.

Conforme última publicação disponível no CVMWeb, o patrimônio líquido do fundo é de R\$ 51.141.704,85

A carteira de investimentos do fundo para o mês de referência é composta por: títulos privados (85,59%), valores a pagar ou receber (7,27%) e títulos públicos federais (7,14%).

Não foi possível localizar o último parecer do auditor independente acompanhado das demonstrações contábeis, onde menciona que as demonstrações contábeis referidas, a posição patrimonial e financeira do fundo.

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.

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 ANGRAPREV, não somente contemplando a emissão desse relatório, mas também 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 ANGRAPREV venha adotar, regras, procedimentos e controles internos que integrem o fluxo de atividades e os manuais de procedimentos na adequação da análise de fundos de investimentos que contemplam sua carteira de investimentos.

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, não comprometendo a liquidez da carteira de investimentos em honrar seus compromissos.

Ainda se tratando do risco de mercado, orienta-se cautela e acompanhamento continuado, buscando a melhor saída para o retorno das aplicações, em um contexto favorável ao desinvestimento.

Sugerimos que sejam apurados com periodicidade os resultados dos fluxos das movimentações, junto com o acompanhamento da leitura do cenário econômico através de nossos informes periódicos, para a prevenção de possíveis resultados negativos no fechamento do período.

A carteira de investimentos do ANGRAPREV apresenta comportamento arrojado, buscando ao longo do período a diversificação em outras classes ou mesmo em vértices atrelados em títulos públicos.

A diversificação é uma técnica que permite reduzir os riscos através da alocação em fundos de investimentos de vários vértices e ativos, 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.

Assim como a diversificação dos ativos que compõe a carteira de investimentos é de suma importância, 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) também é relevante.

Este tipo de diversificação minimiza os riscos dos ativos quanto a possíveis imprudências de gestão, administração e/ou custódia.

A falta da disponibilidade de um relatório que demonstra o casamento do ativo e passivo do ANGRAPREV, dificulta a análise quanto a exposição a fundos de investimentos com menor liquidez, prejudicando assim quanto aos retornos no longo prazo na geração de valor aos futuros beneficiários e principalmente por se tratar de um relatório obrigatório perante as normativas que regulamentam os RPPS.

Esse relatório atende ao segundo semestre do exercício de 2020.

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



Samanta Zaniquelli Delcore

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

CRÉDITO E MERCADO GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS
(C.N.P.J.: 11.340.009/0001-68)

DISCLAIMER

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Esta é apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis. A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade das mesmas, e não devem ser consideradas como tais. As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos e prospectos de divulgação. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, ao risco e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários). Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM. A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.