

CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 26.269.692/0001-61 - Itaú FIC Private Multimercado S&P 500

Segmento: Fundos Estruturados

Tipo de Ativo: Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I

Data do Termo: 01/03/2024

Conclusão do Credenciamento: Fundo enquadrado em relação à Resolução 4963/2021.

INSTITUIÇÕES

Administrador: 60.701.190/0001-04 - Itaú Unibanco

Gestor: 40.430.971/0001-96 - Itaú Unibanco Asset

Art. 21º da Resolução 4963/2021: O administrador atende ao inciso I do parágrafo 2º.

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Data de Início: 19/01/2017

Índice de Referência: S&P 500

Carência: Não há

Prazo de Resgate: D+1

Categoria de Investidor: Geral

Taxa de Administração: 0,80%

Taxa de Performance: Não há

Investe em cotas de outros fundos: Sim

26.269.698/0001-39 - Fundos Estruturados - 10, I - 99,57%

11.419.818/0001-60 - Renda Fixa - 7, I, b - 0,49%

Obs.: Informações referentes à 29/02/2024.

Possui ativos de Emissores Privados: Não

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas

O objetivo do fundo é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem, preponderantemente, em ativos que tenham como principal fator de risco a variação do preço do índice SP 500. O fundo fica sujeito ao risco sistêmico, decorrente de todo o mercado, ao risco referente aos ativos investidos pelo gestor. Há mais riscos que podem ser consultados no regulamento do fundo, mas o destaque cabe aos citados anteriormente.

Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS

O fundo possui liquidez em D+1.

Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos

A composição da carteira está condizente com o regulamento e objetivo propostos.

Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares

O fundo objeto da análise foi comparado com 6 outros fundos, de mesmo benchmark (S&P 500) e enquadramento (10, I) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,80%, ficou abaixo da média de 0,82% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 36,71%, performou acima da média de 35,97%. Base de comparação:

24.633.818/0001-00 - Sicredi FIC Bolsa Americana Multimercado - Tx Adm: 0,30 - Rent 12M: 37,40

30.036.235/0001-02 - Caixa Bolsa Americana Multimercado - Tx Adm: 0,80 - Rent 12M: 36,81

17.453.850/0001-48 - Western Multimercado US 500 - Tx Adm: 1,00 - Rent 12M: 36,61

21.595.829/0001-54 - Safra FIC S&P Reais PB Multimercado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 36,36

18.079.540/0001-78 - Bradesco FIC Multimercado S&P 500 Mais - Tx Adm: 1,50 - Rent 12M: 31,95

Obs.: Rentabilidades com data de fechamento 29/02/2024.

Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance

O objetivo do fundo é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem, preponderantemente, em ativos que tenham como principal fator de risco a variação do preço do índice SP 500, observado que a rentabilidade do fundo será impactada em virtude dos custos e despesas do fundo, inclusive taxa de administração, se houver. Não há cobrança de taxa de performance.

Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável

O fundo não possui carência para resgate. Sua liquidez é em D+1.

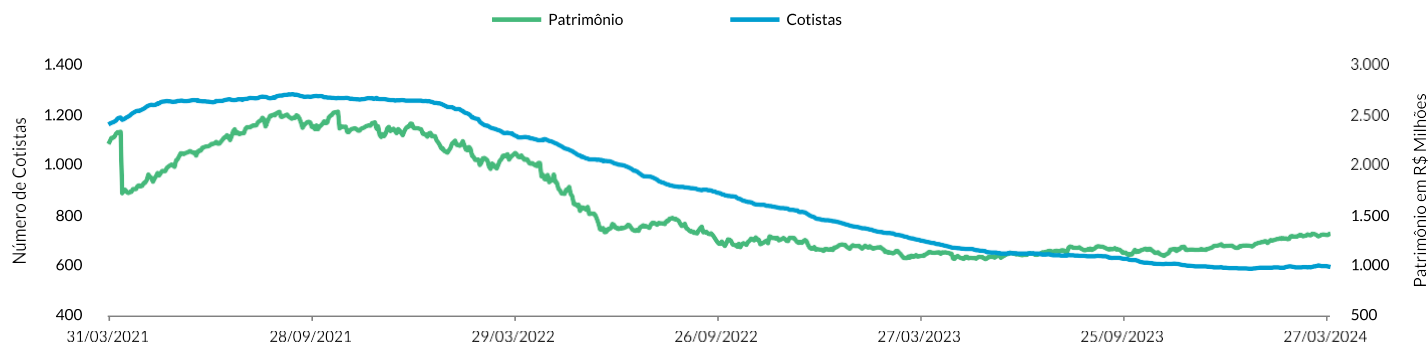
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foram observados 5 fundos da gestora 40.430.971/0001-96, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 05.903.152/0001-18, 00.832.435/0001-00, 00.973.117/0001-51, 04.764.174/0001-81, 32.254.420/0001-90. Em matéria de performance, nenhum ficou acima do benchmark.

Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN

O gestor é responsável pela aplicação dos fundos Master, de acordo com as normas estabelecidas no Regulamento do Fundo. Na data de análise o fundo está aplicando em fundos enquadrados pela CMN.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	1.327.498.548,40	600
Médio em 12 meses	1.179.699.392,04	629
Médio em 24 meses	1.278.454.434,26	763

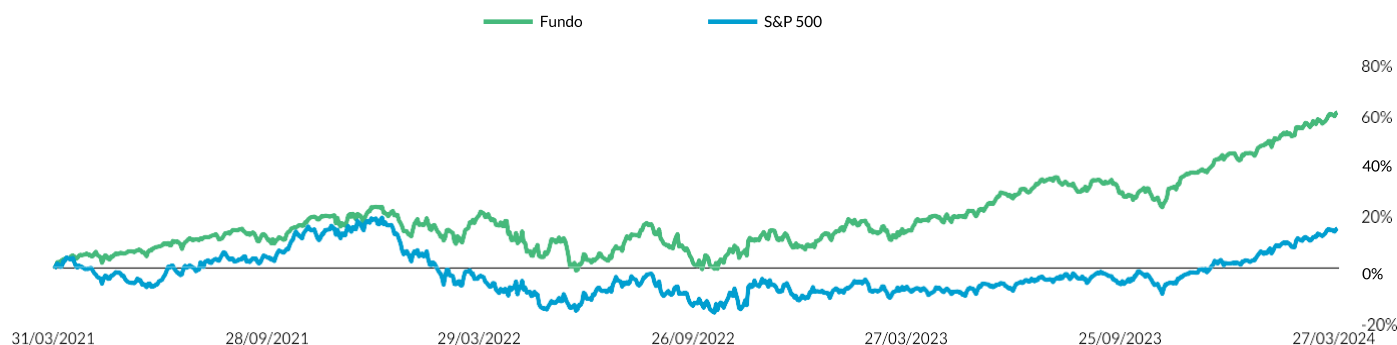
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-5,29	-2,18	4,58	-8,62	0,95	-7,79	10,09	-3,21	-8,62	8,72	6,06	-4,81	-11,92
S&P 500	-9,05	-6,85	-4,75	-5,31	-3,86	1,47	8,08	-4,42	-5,36	5,00	6,12	-7,26	-24,68
≠ S&P 500	3,76	4,67	9,33	-3,32	4,81	-9,26	2,01	1,21	-3,26	3,72	-0,06	2,44	12,76

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	6,49	-1,78	4,03	2,00	1,12	6,99	3,64	-0,95	-4,44	-1,75	9,33	5,17	33,07
S&P 500	3,77	-0,54	0,97	-0,13	2,16	0,69	1,45	1,97	-3,22	-1,22	6,29	2,43	15,27
≠ S&P 500	2,72	-1,25	3,06	2,13	-1,03	6,30	2,19	-2,91	-1,23	-0,52	3,04	2,74	17,80

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,67	5,68											10,97
S&P 500	3,94	5,80											9,98
/= S&P 500	-2,27	-0,13											0,99

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Cotas de Fundos	1.308.105.358,25	100,06
Disponibilidades	70.000,01	0,01
Valores a receber	59.896,59	0,00
Valores a pagar	-855.654,66	-0,07

Obs.: Informações referentes à 29/02/2024.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

Ao assinar o Credenciamento, os responsáveis atestam que:

- Possuem conhecimento dos aspectos que caracterizam este Fundo de Investimento, em relação ao conteúdo de seu Regulamento e de fatos relevantes que possam contribuir para seu desempenho, além de sua compatibilidade ao perfil da carteira e à Política de Investimentos do RPPS;
- Este documento não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos no fundo, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância das condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência e os requisitos e limites previstos na Resolução do CMN, a aderência à Política de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.
- Estão cientes de que a rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura, e que não há qualquer tipo de garantia, implícita ou explícita, prestada pelo emissor deste relatório e/ou empresas coligadas, ou por qualquer mecanismo de seguro, ou ainda pelo Fundo Garantidor de Crédito.

NOME	CPF	ASSINATURA
Igor Fretta Nogueira de Lima	049.436.369-00	Assinado eletronicamente por: Igor Fretta Nogueira de Lima CPF: ***.436.369-** Data: 10/04/2024 18:55:07 -03:00
Alessandra Cristina Hoehn	869.080.659-87	Assinado eletronicamente por: Alessandra Hoehn CPF: ***.080.659-** Data: 10/04/2024 15:43:01 -03:00



MANIFESTO DE ASSINATURAS



Código de validação: RXXFL-YJY97-UYAP8-YFYNF

Esse documento foi assinado pelos seguintes signatários nas datas indicadas (Fuso horário de Brasília):

- ✓ Alessandra Hoehn (CPF ***.080.659-**) em 10/04/2024 15:43 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.181	Não disponível
Autenticação	Navegantes
Aplicação externa	
jfdNe8/fmdYnFq7/B0GpGd2/JCgUCj6LJpmCH3PmOIY=	
SHA-256	

- ✓ Igor Fretta Nogueira de Lima (CPF ***.436.369-**) em 10/04/2024 18:55 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.182	Lat: -26,896771 Long: -48,646571
	Precisão: 24 (metros)
Autenticação	igor.lima@navegantesprev.sc.gov.br
Email verificado	
1xn81Jc1jxW8ZYI0TG63S0myNPw6oGZHflh5Yq49UYA=	
SHA-256	

Para verificar as assinaturas, acesse o link direto de validação deste documento:

<https://assinador.silosign.com.br/validate/RXXFL-YJY97-UYAP8-YFYNF>

Ou acesse a consulta de documentos assinados disponível no link abaixo e informe o código de validação:

<https://assinador.silosign.com.br/validate>