|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[[1]](#footnote-1)**  **(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Nome Fundo** | | | Itaú Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa Fundo De Investimento Em Cotas De Fundos De Investimento | | | | | | | | | | | | | | | CNPJ: 21.838.150/0001-49 | |
| **Administrador** | | | ITAÚ UNIBANCO S.A. | | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | |  | | | CNPJ: 60.701.190/0001-04 | |
| **Gestor** | | | Itaú Unibanco Asset Management LTDA – “IAM” | | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | |  | | | CNPJ: 40.430.971/0001-96 | |
| **Custodiante** | | | ITAÚ UNIBANCO S.A. | | | | | | | | | | | | | | | CNPJ: 60.701.190/0001-04 | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Classificação do Fundo Resolução CMN 4.963/2021:** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | Art. 7º, I, “b” | | | | | | | |  | | | Art. 8º, I | | | | | | | |
|  | Art. 7º, I, “b” | | | | | | | |  | | | Art. 8º, I | | | | | | | |
|  | Art. 7º, I, “b” | | | | | | | |  | | | Art. 8º, I | | | | | | | |
|  | Art. 7º, I, “b” | | | | | | | |  | | | Art. 8º, I | | | | | | | |
|  | Art. 7º, I, “b” | | | | | | | |  | | | Art. 8º, I | | | | | | | |
|  | Art. 7º, III, “a” | | | | | | | |  | | | Art. 9º, II | | | | | | | |
|  | Art. 7º, VII,“a” | | | | | | | |  | | | Art. 9º, II | | | | | | | |
|  | Art. 7º, III, “a” | | | | | | | |  | | | Art. 9º, III | | | | | | | |
|  | Art. 7º, V,“b” | | | | | | | |  | | | Art. 10º, I | | | | | | | |
|  | Art. 8º, I | | | | | | | |  | | | Art. 10º, I | | | | | | | |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | **Identificação dos documentos analisados referentes ao Fundo:** | **Data do doc.** | **Página na internet em que o documento foi consultado ou disponibilizado pela instituição** | | *1. Questionário Padrão Due Diligence para Fundo de Investimento – Seção 2 da ANBIMA* | *05/2022* |  | | *2. Regulamento* | *26/02/2020* | <http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg> | | *3. Lâmina de Informações essenciais* | *05/2022* | <http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg> | | *4. Formulário de informações complementares* | *21/12/2018* | <http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg> | | *5. Perfil Mensal* | *05/2022* | <http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg> | | *6. Demonstração de Desempenho* | *06/2022* | <http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg> | | *7. Relatórios de Rating* | *N/A* |  | | *8. Demonstrações Contábeis* | *31/08/2021* | <http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **II.5 - Forma de Distribuição do Fundo** (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Nome/Razão Social do distribuidor: | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | |
| CPF/CNPJ: | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | |
| Informações sobre a Política de Distribuição: | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Resumo das informações do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Data de Constituição: | | | | | | 19/01/2015 | | | | Data de Início das Atividades: | | | | | | | | 01/06/2015 | |
| Política de Investimentos do Fundo | | | | | | Índice de referência/objetivo de rentabilidade: | | | | | | | | | | | | | |
| O objetivo do fundo é buscar 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 alocarão seus recursos em títulos públicos federais. A rentabilidade do fundo será impactada em virtude dos custos e despesas do fundo, inclusive taxa de administração, se houver.  O fundo aplica em fundos de investimento que utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. | | | | | | | | | | | | | |
| Público-alvo: | | | | | | O fundo, a critério do administrador, receberá recursos de fundos de investimento, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento e/ou pessoas jurídicas, clientes do administrador, do gestor ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.  As operações e investimentos deste fundo observarão, no que couber, os requisitos, condições, modalidades permitidas e vedações estabelecidos pelas disposições legais relativas a fundos de investimento destinados à aplicação  dos recursos de Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios (RPPS) e Entidades Fechadas de Previdência Complementar (EFPC), cabendo aos cotistas que sejam RPPS ou EFPC, o controle e consolidação dos limites de alocação e concentração das posições consolidadas dos recursos de seus planos, estabelecidos pela regulamentação aplicável a tais entidades. | | | | | | | | | | | | | |
| Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate) | | | | | | Prazo de Duração do Fundo | | | | | | | | | | | | Indeterminado | |
| Prazo de Carência (dias) | | | | | | | | | | | | N/A | |
| Prazo para Conversão de Cotas (dias) | | | | | | | | | | | | D+0 | |
| Prazo para Pagamento dos Resgates (dias) | | | | | | | | | | | | D+1 | |
| Prazo Total (dias) | | | | | | | | | | | | D+1 | |
| Condições de Investimento (Custos/Taxas) | | | | | | Taxa de entrada (%) | | | | | | | | | | | | N/A | |
| Taxa de saída (%) | | | | | | | | | | | | N/A | |
| Taxa de administração (%) | | | | | | | | | | | | 0,40% a.a. | |
| Taxa de Performance | | | | | | | | | | | | | |
| Índice de referencia | | | Frequência | | | | | | | | Linha-d`água | | |
| N/A | | |  | | | | | | | | N/A | | |
| Aderência do Fundo aos quesitos estabelecidos na Resolução do CMN relativos, dentre outros, aos gestores e administradores do fundo, aos ativos de crédito privado que compõem sua carteira | | | | | | Aos fundos que permitem alocação em crédito privado, seguem os requisitos estabelecidos pelas legislações vigentes e reguladores do mercado. | | | | | | | | | | | | | |
| Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo: | | | | | | Não há alterações relevantes na estrutura do administrador/gestora. | | | | | | | | | | | | | |
| Análise de fatos relevantes divulgados: | | | | | | <https://www.itau.com.br/relacoes-com-investidores/list.aspx?idCanal=+1MgOvbjDlckPa6GiJlfyA==> | | | | | | | | | | | | | |
| Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos: | | | | | | O fundo segue a legislação do segmento RPPS. | | | | | | | | | | | | | |
| Principais riscos associados ao Fundo: | | | | | | Os principais riscos associados ao fundo são: Operacional, Liquidez, Crédito e Mercado.  Para maiores detalhes consultar o regulamento do fundo. | | | | | | | | | | | | | |
| **Histórico de Rentabilidade do Fundo** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Ano** | | **Nº de Cotistas** | | **Patrimônio Líquido**  **(R$)** | | | | **Valor da**  **Cota do Fundo**  **(R$)** | | | **Rentabilidade**  **(%)** | | | **Variação % do índice de referência** | | **Contribuição em relação ao índice de referência/ ou**  **Desempenho do fundo como % do índice de referência** | | | |
| **2021** | | 247 | | 2.626.754,965,65 | | | | 18,84 | | | 4,53% | | | 10,40% | | - 5,87% | | | |
| **2020** | | 269 | | 3.882.685.363,64 | | | | 18,0250 | | | 2,85% | | | 4,36% | | -1,51% | | | |
| **2019** | | 289 | | 5.156.074.278,85 | | | | 17,524579 | | | 11,91% | | | 3,97% | | 8,15% | | | |
| **2018** | | 57 | | 1.172.042.980,67 | | | | 15,659112 | | | 8,22% | | | 3,97% | | 4,25% | | | |
| **2017** | | 62 | | 1.451.065.616,53 | | | | 14,469927 | | | 12,87% | | | 2,77% | | 10,1% | | | |
| **2016** | | 62 | | 1.223.348.136,09 | | | | 12,819503 | | | 21,48% | | | 6,58% | | 14,89% | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Análise da Carteira do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Composição da carteira (atual)** | | | | **Espécie de ativos** | | | | | | | | | | | | | | | **% do PL** |
|  | | | | | | | | | | | | | | |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento** | | | | CNPJ Fundo(s) | | | | | Classificação Resolução CMN | | | | | | | | | | % do PL |
| 1. 32.265.550/0001-29 | | | | |  | | | | | | | | | | 99,80% |
| 2. | | | | |  | | | | | | | | | |  |
| 3. | | | | |  | | | | | | | | | |  |
| ..... | | | | |  | | | | | | | | | |  |
| **Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo** | | | | Emissor (CPF/CNPJ) | | | | | Tipo de Emissor | | | | | | | | | | % do PL |
|  | | | | |  | | | | | | | | | |  |
|  | | | | |  | | | | | | | | | |  |
|  | | | | |  | | | | | | | | | |  |
|  | | | | |  | | | | | | | | | |  |
|  | | | | |  | | | | | | | | | |  |
| Carteira do Fundo é aderente à Política de Investimentos estabelecida em seu regulamento e com a classificação na Resolução CMN | | | | | | | | | Sim. | | | | | | | | | | |
| Prazo médio da carteira de títulos do Fundo (em meses (30) dias) | | | | | | | | | | | | | | | N/A | | | | |
| Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | |
| **Nota de Risco de Crédito** | | | | | **Agência de risco** | | | | | | | | | | | | | **Nota** | |
|  | | | | | | | | | | | | |  | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:** | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | |
| **Comentários Adicionais** | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | |

**Declaro que tenho 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.**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Data:** | |  | |
| **Responsáveis pela Análise:** | **Cargo** | **CPF** | **Assinatura** |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

1. Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Politica Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS. [↑](#footnote-ref-1)