



IGEPREV
INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIÁRIA
DO ESTADO DO TOCANTINS
COFIN

IGEPREV

Fls. 191

Ass.

Unidade: DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

PROCESSO: 2018/24830/002656

TERMO DE REABERTURA DE PROCESSO

Procedemos à reabertura deste Processo de Credenciamento de 2018 da **ITAÚ ASSET MANAGEMENT**, continuando da folha 191, incluindo este termo de reabertura, em virtude da inclusão do Questionário *Due Diligence* – Seção 2, do Fundo **Itaú Institucional Alocação Dinâmica RF FICFI**, que estava faltando anexar ao processo.

Após archive-se o processo.

Para constar, eu, Meire Gomes da Luz, subscrevo e assino.

Palmas – TO, 27 de novembro de 2019.

Carimbo/Assinatura

Meire Gomes da Luz
Operador de Microcomputador
Mat.: 992814-1



► Questionário Padrão
Due Diligence para Fundos de
Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

Itaú Asset Management

Questionário preenchido por:

Investment Communication

Data:

30 de Abril de 2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")



Sumário

Apresentação.....	3
1) Informações sobre o Fundo de Investimento.....	4
1 - Alterações desde a última atualização	4
2 - Informações Qualitativas.....	7
2.1 – Perfil.....	7
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo	8
2.3 - Estratégias e Carteiras.....	8
3 - Informações Adicionais.....	11
4 - Gestão de Risco	12
5 – Comportamento do Fundo em Crises	14
6 - Três períodos de maior perda do Fundo (<i>peak to valley</i>)	14
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	14
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	14
9 – Atendimento aos Cotistas	15
10 - Investimento no Exterior.....	15
11 – Anexos	16
2) Declaração.....	17
3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento	18
Atualizar Sumário.....	

(Para atualizar o sumário, clique no texto acima com o botão direito, atualizar campo, atualizar apenas os números de página)



Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.



1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização	
1.1	Nome
Itaú Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa FICFI	
1.2	CNPJ
21.838.150/0001-49	
1.3	Data de início
01/06/2015	
1.4	Classificação CVM
Renda Fixa	
1.5	Classificação ANBIMA
Renda fixa - Duração livre - Crédito livre	
1.6	Código ANBIMA
399892	
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?
Não.	
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)
Longo Prazo sem Compromisso	
1.9	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.	
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?
Sim, legislação de EFPC, CVM 555 e RPPS	
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?
Não	
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)
Conta isenta: 8541 22367-6	
Conta tributada: 8541 22366-8	
1.13	Conta CETIP (nº)
21763.44-3	
1.14	Administração (indique contato para informações).
A Administração é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)	
1.15	Custódia (indique contato para informações).
A Custódia é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)	
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).
PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes	
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:
Escriturador	Não se aplica

Associação Brasileira das Entidades
dos Mercados Financeiro e de Capitais



Agente de depósito (Custódia Física)	Não se aplica
Consultor Especializado	Não se aplica
Assessor Jurídico	Não se aplica
Seguradora	Não se aplica



1.18	Cotização: abertura ou fechamento? Fechamento														
1.19	Regras para aplicação e resgate:														
	<table> <tr> <td>Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)</td><td>Aplicação: D+0 Liquidez: diária Horário para movimentações: 14:00</td></tr> <tr> <td>Carência/Tempo mínimo para permanência (<i>lock-up period</i>) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.</td><td>Não há carência.</td></tr> <tr> <td>Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)</td><td>Fechamento às 14:00; Conversão do resgate: D+0 (da solicitação) Pagamento do resgate: D+1 (da conversão).</td></tr> <tr> <td>Aplicação inicial mínima</td><td>R\$5.000,00</td></tr> <tr> <td>Aplicação máxima por cotista</td><td>N/A</td></tr> <tr> <td>Aplicação adicional mínima</td><td>R\$1,00</td></tr> <tr> <td>Resgate Mínimo</td><td>R\$1,00</td></tr> </table>	Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	Aplicação: D+0 Liquidez: diária Horário para movimentações: 14:00	Carência/Tempo mínimo para permanência (<i>lock-up period</i>) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	Não há carência.	Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	Fechamento às 14:00; Conversão do resgate: D+0 (da solicitação) Pagamento do resgate: D+1 (da conversão).	Aplicação inicial mínima	R\$5.000,00	Aplicação máxima por cotista	N/A	Aplicação adicional mínima	R\$1,00	Resgate Mínimo	R\$1,00
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	Aplicação: D+0 Liquidez: diária Horário para movimentações: 14:00														
Carência/Tempo mínimo para permanência (<i>lock-up period</i>) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	Não há carência.														
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	Fechamento às 14:00; Conversão do resgate: D+0 (da solicitação) Pagamento do resgate: D+1 (da conversão).														
Aplicação inicial mínima	R\$5.000,00														
Aplicação máxima por cotista	N/A														
Aplicação adicional mínima	R\$1,00														
Resgate Mínimo	R\$1,00														
1.20	Taxa de Entrada (<i>upfront fee</i>)														
	Não														
1.21	Taxa de Saída (<i>redemption fee</i>)														
	Não														
1.22	Taxa de Administração														
	A taxa de administração fixa e anual é de 0,40% (zero vírgula quarenta por cento) provisionada por dia útil, mediante divisão da taxa anual por 252 dias, apropriada e paga mensalmente.														
1.23	Taxa de Administração máxima														
	0,40% a.a.														
1.24	Taxa de Performance														
	<table> <tr> <td>• %</td><td>N/A</td></tr> <tr> <td>• Benchmark</td><td>N/A</td></tr> <tr> <td>• Frequência</td><td>N/A</td></tr> <tr> <td>• Linha-d'água</td><td>N/A</td></tr> </table>	• %	N/A	• Benchmark	N/A	• Frequência	N/A	• Linha-d'água	N/A						
• %	N/A														
• Benchmark	N/A														
• Frequência	N/A														
• Linha-d'água	N/A														



1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?
O custo total estimado aproximado é 0,0033% do PL ao ano.	
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?
Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.	
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?
Não	
2 - Informações Qualitativas	
2.1 – Perfil	
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.
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.	
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.
Não houve alterações desde a abertura do fundo.	
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.
O primeiro passo do processo de alocação é a definição das obrigações e objetivos do cliente. Posteriormente, através da análise de dados históricos e estimativas de nossos analistas e economistas, definimos os fatores de risco e o modelo de alocação que melhor atendem as necessidades levantadas. A alocação entre as classes de ativos tem um foco top-down e considera o risco de cada classe individualmente e a correlação esperada entre elas. O próximo passo é a definição das posições dentro de cada classe de ativos. A escolha dos ativos segue uma análise bottom-up, considerando a convicção no cenário e os riscos e retornos esperados. Por fim, o portfólio é reavaliado diariamente com formalização das bandas de alocação entre as classes de ativos e pontos de entrada e saída de cada posição. Adicionalmente, limites de risco, stress e liquidez são monitorados por uma equipe independente.	
2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.
Por favor referir ao texto acima.	



2.1.5	Cite as premiações, ratings e rankings.						
A Itaú Asset Management foi premiada pela décima vez e a sexta consecutiva, como Melhor Gestora de Fundos do Ano pelo Guia EXAME de Investimentos 2018. E também foi escolhida, pela mesma publicação, Melhor Gestora de Fundos em Multimercado, além de Melhor Gestora de Fundos de Varejo Seletivo, Alta Renda e Atacado. A Itaú Asset Management não possui ratings por fundo.							
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo							
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).						
A equipe de <i>Portfolio Solutions</i> é formada por 16 profissionais com média de 14 anos de experiência no mercado e 10 na Itaú Asset Management.							
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.						
N/A							
2.3 - Estratégias e Carteiras							
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:						
<table border="0"> <tr> <td>▪ Brasil (exclusivamente)</td> <td>Sim</td> </tr> <tr> <td>▪ Brasil (predominantemente)</td> <td>especifique Não</td> </tr> <tr> <td>▪ Global</td> <td>especifique Não</td> </tr> </table>		▪ Brasil (exclusivamente)	Sim	▪ Brasil (predominantemente)	especifique Não	▪ Global	especifique Não
▪ Brasil (exclusivamente)	Sim						
▪ Brasil (predominantemente)	especifique Não						
▪ Global	especifique Não						
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.						
N/A							
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: <i>stop loss</i> , <i>stop gain</i> , concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).						

UNIDADE: DIRETORIA DE INVESTIMENTOS
PROCESSO Nº: 2018/24830/002656

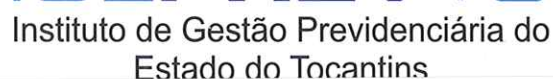
TERMO DE ENCERRAMENTO DO VOLUME I

Aos 27 (vinte e sete) dias do mês de novembro de 2019 neste Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Tocantins, procedemos ao encerramento do Volume I do Processo nº. 2018/24830/002656, contendo 200 folhas no total, incluindo este Termo.

Para constar, eu, Meire Gomes da Luz, subscrevo e assino.



Meire Gomes da Luz
Operador de Microcomputador
Matrícula nº 992814-1



Assunto: CREDENCIAMENTO DO BANCO ITAÚ - VOL II



CIDADE

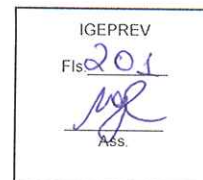
OUTRAS ANOTAÇÕES

ANDAMENTO

[illegible]



IGEPREV
INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIÁRIA
DO ESTADO DO TOCANTINS
COFIN



Unidade: DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

PROCESSO: 2018/24830/002656

TERMO DE ABERTURA DE PROCESSO

Procedemos a abertura deste Processo de **Edital de Credenciamento de 2019**, que se inicia com a folha nº 201, incluindo este termo de Abertura, em virtude do volume nº I ter sido encerrado com a folha nº 200, em observância ao disposto no Decreto nº 5.378, de 16 de fevereiro de 2016, art. 50, II, de no máximo 200 folhas por volume.

Para constar, eu, Meire Gomes da Luz, subscrevo e assino.

Palmas – TO, 27 de novembro de 2019.

Carimbo/Assinatura



A Superintendência de Gestão de Risco Asset é responsável pelas definições de risco para cada papel e portfólio. No caso dos portfólios, o primeiro passo é definir os limites de risco para cada carteira, que será proposto e sujeito à aprovação no Comitê de Produtos.

A definição de cada limite de risco é baseada em diretrizes de investimento, simulações para cada medida como Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR), Stress Test e outras restrições específicas de acordo com cada cliente e segmento.

O controle de risco é formalizado em um mandato do fundo para uso interno e há controles em diferentes níveis (incluindo no nível do ativo).

Seguem abaixo as principais medidas de risco que usamos para monitorar e controlar os portfólios dos nossos clientes:

Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR) e Tracking Error Ex-ante:

- Modelo: Paramétrico (Métricas de Risco) e Não Paramétrico (Simulação de Monte Carlo para opções);
- Volatilidade e Correlação: EWMA - Exponentially Weighted Moving Average (= 0.94);
- Intervalo de confiança: 95% ou 99% e Holding Period: 1, 21 e 252 dias úteis

Stress Test:

- Valuation completa para o pior cenário;
- Cenários: Crises históricas, Cenários Prospectivos.

Risco de Liquidez:

- Curva de liquidez.
- Curva de Passivo, que é definida como o conjunto de piores resgates ocorridos em diferentes períodos que vão de 1 dia até 252 dias úteis;
- Estresse da Curva de Passivo, a partir do fator do grau de concentração dos cotistas. Este fator utiliza o coeficiente HHI (Herfindahl-Hirschman Index);

Outras ferramentas de monitoramento, sob demanda ou para necessidade de análise:

- DV01 para juros: 1 basis point para cada yield;
- GAP Analysis per market: Graph exposure % NAV versus duration

Para mais informações sobre a gestão de riscos, por favor referir a seção 4 do questionário.

2.3.4 Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?

É vedado ao Fundo, direta ou indiretamente, realizar operações denominadas day trade.

2.3.5 – Uso de Derivativos

2.3.5.1 Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:

• Proteção de carteira ou de posição	Sim ☒	Não ☐
• Mudança de remuneração/indexador	Sim ☒	Não ☐
• Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)	Sim ☐	Não ☒
• Alavancagem	Sim ☐	Não ☒

2.3.5.2 Mercados em que são utilizados derivativos:



Juros	Sim ☒ Não ☐
Câmbio	Sim ☐ Não ☒
Ações	Sim ☐ Não ☒
Commodities	Sim ☐ Não ☒
Em Bolsas:	
• Com garantia	Sim ☒ Não ☐
▪ Sem garantia	Sim ☐ Não ☒
Em balcão:	
▪ Com garantia	Sim ☒ Não ☐
▪ Sem garantia	Sim ☐ Não ☒
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	
2.3.6.1 de fundos de terceiros?	Sim ☐ Não ☒
2.3.6.2 de fundos do gestor?	Sim ☒ Não ☐



3 - Informações Adicionais	
3.1	PL atual
PL atual FI: R\$ 4.328.977.370,37 PL atual FIC: R\$ 1.292.273.719,79 (Data base: abril de 2019)	
3.2	PL médio em 12 meses
PL médio FI: R\$ 4.328.977.370,37 PL médio FIC: R\$ 1.372.290.818,77 (Data base: abril de 2019)	
3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
PL atual da estratégia: R\$ 452,75 MM *Dados de Março 2019	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
A capacidade da estratégia é definida e reavaliada de forma periódica em comitê interno. Considera-se a liquidez do mercado, o prazo para o resgate e a capacidade da gestão de obter uma performance diferenciada na geração de alpha.	
3.5	Número de cotistas
A estratégia conta com 62 cotistas. - Quantidade de cotistas diretos do FIC (data base: Abril de 2019)	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
Informação indisponível.	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
Não há regras específicas para concentração de passivo.	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
Percentual detido pelos cinco maiores cotistas: 45,49% Percentual detido pelos dez maiores cotistas: 72,09% (data base: abril de 2019)	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
Não houve mudanças nos prestadores de serviços do fundo desde o início da operação.	
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
A PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes realiza auditoria para este fundo desde junho de 2015.	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	



4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo. Não é permitido crédito privado.
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo. O fundo segue a política de liquidez do Itaú Asset, de forma que sua liquidez seja compatível com o prazo para pagamento dos pedidos de resgate. São usados os controles de Curva de Liquidez, Curva de Passivo e Curva de Passivo Estressada.
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle. O Fundo não opera derivativos sem garantia.
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal? A precificação de ativos/derivativos segue o Manual de Precificação da WMS. As metodologias de precificação são definidas pela Diretoria Gestão Risco e Planejamento.
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, Tracking Error e Expected Shortfall)? VaR: metodologia paramétrica. Utiliza-se EWMA com lambda de 0,94 para o cálculo das volatilidades e covariâncias.
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5. A utilização do limite de risco é calculada diariamente com base na posição de fechamento do Fundo. Há três níveis de alerta reportados: alerta 1 utilização entre 70% e 85%, alerta 2 utilização entre 85% e 100% e alerta 3 utilização acima do limite. Os alertas 1 e 2 são reportados pela área de Risco para a ciência da gestão via e-mail. No caso do alerta 3, adicionalmente ao e-mail, o apontamento é cadastrado no sistema de follow up de desenquadramentos. A gestão deve preencher no sistema a justificativa para o estouro do limite e apresentar um plano de ação para a sua adequação ao mandato. As informações são analisadas pela área de Risco, que concordando com os argumentos passará a acompanhar o prazo dado para a regularização do limite. A área de Risco tem a decisão final sobre a zeragem do Fundo caso julgue necessário.
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto stress)? O limite é de 1,2% do PL.
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5. O orçamento de VaR é global e não por classe de ativos.
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê? O fundo em 18,19 e 22 e maio de 2017 o fundo ultrapassou o limite.
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente. Historicamente o máximo da utilização de Var foi de 200% do limite em 18/05/2017.
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos (data base: 22/05/2019)
3 meses?	0,2135%
6 meses?	0,2623%
12 meses?	0,1500%
24 meses?	0,2212%
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)? Não é permitido o Fundo se alavancar.
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de stress? O limite é de 10,00% do PL.
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê? O fundo nunca atingiu o limite.
4.15	Qual o stress médio do Fundo nos últimos (data base: 22/05/2019)

Associação Brasileira das Entidades
dos Mercados Financeiro e de Capitais



3 meses?	3,2549%
6 meses?	4,0620%
12 meses?	2,3264%
24 meses?	2,9923%
4.16	Comente o último <i>stop loss</i> relevante do Fundo.
N/A	



5 – Comportamento do Fundo em Crises					
	Período	Evento	Comportamento	Explicação	
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Ago/98	Crise da Rússia	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Out/98	Quebra do LTCM	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Jan/99	Desvalorização do Real	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Mar/00	Crise do Nasdaq	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Abr/01	Apagão	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Set/01	Ataques terroristas nos EUA	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Jun/02	Marcação a mercado	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench	N/A	
6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)					
	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1.	16/05/2017 18/05/2017		Fundo: -5,01% Bench: 0%		49 Dias
2.	20/10/2016 14/11/2016		Fundo: -2,54% Bench: 0,26%		24 Dias
3.	13/05/2016 27/05/2016		Fundo: -1,22% Bench: 0%		5 Dias
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)					
7.1	Atribuição		Contribuição (%)		
	N/A		N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).				
Não houve mudança de estratégia desde o início do fundo.					
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?				
Não.					
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores					
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade?				



	Com que defasagem?
	Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
	Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.
8.3	Com que frequência é possível realizar <i>conference calls</i> com o gestor dos fundos?
	As <i>conference calls</i> podem ser feitas sob demanda com o representante da gestão.
	9 – Atendimento aos Cotistas
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
	Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
	Site Itaú Institucionais. Atualizado regularmente. http://www.itauinstitucionais.com.br/
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
	SAC Itaú e área de atendimento Asset - Email: atendimentoasset@itau-unibanco.com.br – horário comercial e pelo telefone (11) 3631-2555.
	10 - Investimento no Exterior
	N/A
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
	N/A
10.2	Quais os riscos envolvidos?
	N/A
10.3	Qual o produto?
	N/A
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
	N/A
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
	N/A
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, <i>prime broker</i> , entre outros)
	N/A
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
	N/A
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
	N/A
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
	N/A



11 – Anexos		
11.1	Regulamento	Sim ☐ Não ☐
11.2	Prospecto	Sim ☐ Não ☐
11.3	Última lâmina	Sim ☐ Não ☐
11.4	Último Informe de Perfil Mensal (Arquivo XML - Padrão CVM) da carteira	Sim ☐ Não ☐
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo (Arquivo XML - Padrão CVM)	Sim ☐ Não ☐
11.6	Relatórios de Gestão	Sim ☐ Não ☐



2) Declaração

Declaramos que este questionário foi preenchido, revisado e assinado por pessoas devidamente autorizadas a fazê-lo, respondendo esta instituição pela sua exatidão, veracidade e integridade da informação de todo o conteúdo prestado neste documento e de seus anexos.

Comprometemo-nos a manter todas as informações deste questionário devidamente atualizadas semestralmente, enviando nova versão do questionário aos distribuidores e alocadores nos meses de janeiro e julho, com data-base dezembro e junho, com exceção das informações contidas no item 3 – Eventos Importantes, as quais serão atualizadas e comunicadas imediatamente após a sua ocorrência.

Local: <u>São Paulo - SP</u>	Data: <u>05/06/2019</u>
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____


Elaine Murcia Manetti
Gerente Poder Público



3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos


Elaine Murcia Manetti
Gerente Poder Público

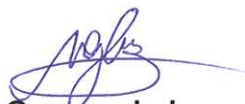
UNIDADE: DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

PROCESSO Nº: 2018/24830/002656

TERMO DE ENCERRAMENTO DE PROCESSO

Aos 27 (vinte e sete) dias do mês de novembro de 2019 neste Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Tocantins, procedemos ao encerramento do Volume I do Processo nº. 2018/24830/002656, contendo 200 folhas no total, incluindo este Termo.

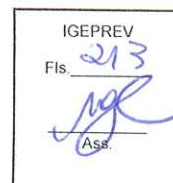
Para constar, eu, Meire Gomes da Luz, subscrevo e assino.



Meire Gomes da Luz
Operador de Microcomputador
Matrícula nº 992814-1



IGEPREV
INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIÁRIA
DO ESTADO DO TOCANTINS
COFIN



Unidade: DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

PROCESSO: 2018/24830/002656

TERMO DE REABERTURA DE PROCESSO

Procedemos à reabertura deste Processo de Credenciamento de 2018 da **ITAÚ ASSET MANAGEMENT**, continuando da folha 213, incluindo este termo de reabertura, em virtude da inclusão do Credenciamento de dois fundos, sendo eles os fundos **Itaú Ações Dunamis FIC FI** e **Itaú Renda Fixa IMA-B Ativo Fic Fi**.

Após archive-se o processo.

Para constar, eu, Victor Barros Prehl, subscrevo e assino.

Palmas – TO, 27 de novembro de 2019.



Carimbo/Assinatura

Questionário ANBIMA de due diligence para contratação de Gestor de Recursos de Terceiros

Contratado:

Itaú Asset Management

Contratante:

Questionário preenchido por:

Time de vendas especializadas

Data:

30/08/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A").

Versão: [-]

Apresentação

Este questionário é baseado no Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros (“Código”). Ele tem o objetivo de auxiliar o administrador fiduciário no processo de contratação de gestores de recursos de terceiros para os fundos de investimento.

O questionário busca abordar, minimamente, a adoção de práticas consistentes, objetivas e passíveis de verificação que sejam suficientes não só para entender e mensurar os riscos associados à prestação de serviço como também para garantir um padrão aceitável da instituição a ser contratada.

O anexo ao questionário trata de informações específicas dos fundos de investimento.

O administrador fiduciário poderá adicionar outras questões julgadas relevantes na forma de anexo a esse questionário.

Este questionário deve ser respondido por profissional com poderes de representação, e qualquer alteração em relação às respostas enviadas e aos documentos encaminhados após o preenchimento deste questionário deve ser enviada à instituição que contratou a prestação de serviço em até cinco dias úteis da referida alteração.

Este questionário entrará em vigor em 11 de janeiro de 2019.

Sumário

Apresentação.....	1
1. Alterações desde a última atualização	4
2. Perfil	6
3. Equipe de gestão do fundo	7
4. Estratégias e carteiras.....	7
5. Uso de derivativos.....	8
6. Compra de cotas de fundos de investimento	9
7. Informações adicionais	9
8. Gestão de risco.....	10
9. Comportamento do fundo em crises	12
10. Três períodos de maior perda do fundo.....	12
11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos	13
12. Relacionamento com distribuidores/alocadores	13
13. Atendimento aos cotistas	14
14. Investimento no exterior	14
15. Anexos (quando aplicável)	15

ANEXO I – FUNDOS DE INVESTIMENTO

1. Alterações desde a última atualização

1.1	Nome do fundo
Itaú Ações Dunamis Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento	
1.2	CNPJ
24.571.992/0001-75	
1.3	Data de início
12/09/2016	
1.4	Classificação ANBIMA
Ações Livre	
1.5	Código ANBIMA
423701	
1.6	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?
Não.	
1.7	Classificação tributária (CP/LP/Ações)
Renda Variável	
1.8	Descreva o público-alvo.
O fundo, a critério do administrador, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do administrador, do gestor ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.	
1.9	O regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução do CMN?
Sim, o regulamento prevê adequação à EFPC, RPPS e CVM 555.	
1.10	Conta corrente (banco, agência, nº)
Conta isenta: 8541 28434-8 Conta tributada: 8541 28433-0	
1.11	Conta CETIP (nº)
24064.44-8	
1.12	Administração (indique contato para informações).
A Administração é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)	
1.13	Custódia (indique contato para informações).

A Custódia é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)

1.14 Auditoria externa

Pricewaterhousecoopers Auditores Independentes

Caso se aplique, informar:	
Escriturador	Não se aplica.
Custodiante	Não se aplica.
1.15 Consultor Especializado	Não se aplica.
Assessor Jurídico	Não se aplica.
Co-gestor	Não se aplica.
Distribuidor	Não se aplica.
Outros	Não se aplica.

1.16 Cotização: abertura ou fechamento?

Fechamento.

Regras para aplicação e resgate:	
1.17 Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	Aplicação: D+0 Liquidez: diária Horário para movimentações: 15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	N/A
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	Conversão do resgate: D+21 dias úteis (da solicitação) Pagamento do resgate: D+2 dia útil (da conversão).
Aplicação inicial mínima	R\$ 100,00
Aplicação máxima por cotista	N/A
Aplicação adicional mínima	R\$ 100,00
Resgate mínimo	R\$ 100,00

1.18 Taxa de Entrada (upfront fee)

Não.

1.19 Taxa de Saída (redemption fee)

Não.

1.20 Taxa de administração

A taxa de administração fixa e anual é de 1,9% provisionada por dia útil, mediante divisão da taxa anual por 252 dias, apropriada e paga mensalmente.

1.21 Taxa de administração máxima

2,0% a.a.

1.22 Taxa de custódia máxima

N/A

1.23	Taxa de Performance	
	% (Percentual)	20% a.a.
	Benchmark	IBOVESPA FECHAMENTO
	Frequência	Calculada a partir da valorização dos ativos do fundo, provisionada por dia útil como despesa do fundo e apropriada no mês subsequente ao encerramento dos meses de junho e dezembro de cada ano ou proporcionalmente, desde que o período não seja inferior a 6 (seis) meses, na hipótese de resgate.
	Linha-d'água (sim ou não)	Sim.
	Método de cálculo (ativo/passivo/ajuste)	Ativo - Variação do Patrimônio Líquido – Calculada a partir da valorização dos ativos do fundo.

1.24 Despesas do fundo pagas ao grupo econômico do administrador (e da gestora, se este for diferente) excluindo-se as taxas de Administração e de Performance.

O custo total estimado aproximado é 0,0015% do PL ao ano.
(Data base: agosto de 2019).

1.25 Há acordo de remuneração com cláusula de reversão de rebate para o fundo? (pagamento e/ou recebimento).

Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.

2. Perfil

2.1 Descreva o fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.

O fundo não possui um índice de referência (retorno total) e tem como objetivo superar qualquer benchmark de renda variável no longo prazo, através de um portfólio concentrado em ações de companhias brasileiras, utilizando-se de diferenciada análise fundamentalista e rigoroso processo de investimento. O Índice Bovespa será apenas uma referência econômica e não uma meta ou parâmetro para a seleção dos papéis.

2.2 Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do fundo.

Não houve alterações desde a abertura do fundo.

2.3 Descreva o processo decisório de investimento deste fundo de investimento.

O processo de investimento inicia-se com a geração de ideias através de uma disciplina de reuniões diárias, semanais e mensais. As reuniões são desenhadas para cobrir diferentes aspectos do processo de investimento como seleção de papéis, posicionamento tático, gestão de risco e cenário macro. Combinamos análise fundamentalista com visão top-down integrada entre os times de gestão Brasil e Nova Iorque. Deste modo, a análise das empresas tem um foco em bottom-up onde avaliamos a dinâmica (qualidade dos fundamentos), valuation (avaliação de preço) e sentimento de mercado para cada papel, considerando também as perspectivas do cenário para os setores na decisão de investimento. A construção do portfólio se baseia em uma classificação dos investment cases de acordo com grau de convicção, considerando correlação esperada entre as posições. A escolha de instrumentos e tamanho das posições é feita de forma que portfólios tenham uma exposição homogênea entre os fatores de risco ao longo do tempo. No processo de gestão de risco, ocorre uma reavaliação diária do portfólio com formalização de pontos de entrada, saída, stops e pontos de reavaliação. Adicionalmente, limites de risco, stress e liquidez são monitorados por uma equipe independente.

2.4 Cite as premiações, ratings e rankings dos últimos 05 anos.

A Itaú Asset Management foi premiada pela décima vez e a sexta consecutiva, como Melhor Gestora de Fundos do Ano pelo Guia EXAME de Investimentos 2018. E também foi escolhida, pela mesma publicação, Melhor Gestora de Fundos em Multimercado, além de Melhor Gestora de Fundos de Varejo Seletivo, Alta Renda e Atacado. A Itaú Asset Management não possui ratings por fundo.

3. Equipe de gestão do fundo

3.1 Cite os profissionais envolvidos na gestão

A equipe de gestão é formada por 12 profissionais com média de 13 anos de experiência no mercado e em média 8 anos de experiência na Itaú Asset Management.

3.2 Cite o histórico de alterações significativas na equipe nos últimos 05 anos.

N/A

4. Estratégias e carteiras

4.1 Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o fundo, em cenários de stress.

A Superintendência de Gestão de Risco Asset é responsável pelas definições de risco para cada papel e portfólio. No caso dos portfólios, o primeiro passo é definir os limites de risco para cada carteira, que será proposto e sujeito à aprovação no Comitê de Produtos.

A definição de cada limite de risco é baseada em diretrizes de investimento, simulações para cada medida como Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR), Stress Test e outras restrições específicas de acordo com cada cliente e segmento.

O controle de risco é formalizado em um mandato do fundo para uso interno e há controles em diferentes níveis (incluindo no nível do ativo).

Seguem abaixo as principais medidas de risco que usamos para monitorar e controlar os portfólios dos nossos clientes:

Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR) e Tracking Error Ex-ante:

- Modelo: Paramétrico (Métricas de Risco) e Não Paramétrico (Simulação de Monte Carlo para opções);
- Volatilidade e Correlação: EWMA - Exponentially Weighted Moving Average (= 0.94);
- Intervalo de confiança: 95% ou 99% e Holding Period: 1, 21 e 252 dias úteis

Stress Test:

- Valuation completa para o pior cenário;
- Cenários: Crises históricas, Cenários Prospectivos.

Risco de Liquidez:

- Curva de liquidez.
- Curva de Passivo, que é definida como o conjunto de piores resgates ocorridos em diferentes períodos que vão de 1 dia até 252 dias úteis;
- Estresse da Curva de Passivo, a partir do fator do grau de concentração dos cotistas. Este fator utiliza o coeficiente HHI (Herfindahl-Hirschman Index);

Outras ferramentas de monitoramento, sob demanda ou para necessidade de análise:

- DV01 para juros: 1 basis point para cada yield;
- GAP Analysis per market: Graph exposure % NAV versus duration

Para mais informações sobre a gestão de riscos, por favor referir a seção 8 do questionário.

4.2 O fundo pode realizar operações de day trade?

É vedado ao Fundo, direta ou indiretamente, realizar operações denominadas day trade.

5. Uso de derivativos

5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:		
	Proteção de carteira ou de posição	SIM (X)	NÃO ()
	Mudança de remuneração/indexador	SIM (X)	NÃO ()
	Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)	SIM ()	NÃO (X)

Alavancagem		SIM ()	NÃO (X)
Mercados em que são utilizados derivativos:			
Juros		SIM (X)	NÃO ()
Câmbio		SIM ()	NÃO (X)
Ações		SIM (X)	NÃO ()
Commodities		SIM ()	NÃO (X)
5.2 Em Bolsas:			
Com garantia		SIM (X)	NÃO ()
Sem garantia		SIM ()	NÃO (X)
Em Balcão			
Com garantia		SIM ()	NÃO ()
Sem garantia		SIM ()	NÃO ()
5.3	Qual a abordagem da gestora no investimento em ativos de crédito privado?		
Operações com crédito privado não são permitidas.			

6. Compra de cotas de fundos de investimento

6.1	De fundos de terceiros?	SIM ()	NÃO (X)
6.2	De fundos da gestora?	SIM (X)	NÃO ()

7. Informações adicionais

7.1	PL atual.
PL atual FI: R\$3.323.316.169,21	
PL atual FIC: R\$2.860.793.399,75	
(Data base: 30/08/2019)	
7.2	PL médio em 12 (doze) meses.
PL médio FI: R\$1.343.742.062,77	
PL médio FIC: R\$1.035.730.122,84	
(Data base: 30/08/2019)	
7.3	PL atual da mesma estratégia sob gestão da gestora.
O PL atual total da estratégia Unconstrained sob gestão da empresa é de R\$ 7.559,42 MM.	
(Data base: junho de 2019)	

7.4 Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do fundo e de sua estratégia? Quais são os critérios de definição?

A capacidade da estratégia é definida e reavaliada de forma periódica em comitê interno. Considera-se a liquidez do mercado, o prazo para o resgate e a capacidade da gestão de obter uma performance diferenciada na geração de alpha.

7.5 Número de cotistas.

O fundo conta com 38.325 cotistas considerando a soma de:

- Quantidade de cotistas diretos do FI, desconsiderando os fundos espelho
- Quantidade de cotistas dos fundos espelho do FI

(Data base: julho de 2019)

7.6 Qual percentual do passivo do fundo representa aplicações da gestora, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?

Informação indisponível.

7.7 Descreva as regras de concentração de passivo.

Não há regras específicas para concentração de passivo.

7.8 Percentuais detidos pelos dez maiores cotistas.

Percentual detido pelos dez maiores cotistas: 25,53%

(Data base: julho de 2019)

7.9 Houve alguma mudança de prestadores de serviços de administração fiduciária e/ou de custódia nos últimos 05 anos da operação do fundo? Quando?

Não.

7.10 A última demonstração financeira foi emitida com obteve algum parecer modificado (com ressalva, com abstenção de opinião, ênfase, parecer adverso opinião) pelo auditor independente?

N/A

8. Gestão de risco

8.1 Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do fundo.

Não é permitido ao fundo alocar em crédito privado.

8.2 Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do fundo.

O fundo segue a política de liquidez do Itaú Asset, de forma que sua liquidez seja compatível com o prazo para pagamento dos pedidos de resgate. São usados os controles de Curva de Liquidez, Curva de Passivo e Curva de Passivo Estressada.

8.3 Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.

O Fundo não opera derivativos sem garantia.

8.4 Se houver na carteira do fundo, ativos/derivativos ilíquidos/exóticos, como a gestora realiza o acompanhamento?

A precificação de ativos/derivativos segue o Manual de Precificação da WMS. As metodologias de precificação são definidas pela Diretoria Gestão Risco e Planejamento.

8.5 Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, Tracking Error e Expected Shortfall)?

TE - Metodologia Paramétrica. Utiliza-se EWMA com lambda de 0,94 para o cálculo das volatilidades e covariâncias.

8.6 Existem limites adicionais àqueles que constam no regulamento/regulação (por ex: concentração por setor, emissor, contraparte, tipo de risco)? Quais?

O fundo possui limite de Tracking Error em relação ao Ibovespa.

8.7 Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 8.5

A utilização do limite de risco é calculada diariamente com base na posição de fechamento do Fundo. Há três níveis de alerta reportados: alerta 1 utilização entre 70% e 85%, alerta 2 utilização entre 85% e 100% e alerta 3 utilização acima do limite.

Os alertas 1 e 2 são reportados pela área de Risco para a ciência da gestão via e-mail. No caso do alerta 3, adicionalmente ao e-mail, o apontamento é cadastrado no sistema de follow up de desenquadramentos. A gestão deve preencher no sistema a justificativa para o estouro do limite e apresentar um plano de ação para a sua adequação ao mandato. As informações são analisadas pela área de Risco, que concordando com os argumentos passará a acompanhar o prazo dado para a regularização do limite. A área de Risco tem a prerrogativa de zerar o Fundo caso julgue necessário.

8.8 Qual o limite da(s) metodologia(s) citada no item 8.5?

O limite de TE é de 20% a.a.

8.9 De que forma é apurado o consumo dos limites dados pela(s) metodologia(s) citada(s) no item 8.5?

O orçamento de TE é global e não por classe de ativos.

8.10 Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 8.5 foi excedido, por qual motivo e qual o máximo atingido? Comente.

O Fundo não atingiu o limite nos últimos 24 meses.

Qual o VaR/B-VaR/TE médio do Fundo nos últimos:

8.11	3 meses?	7,4127%
	6 meses?	6,7107%
	12 meses?	6,4866%
	24 meses?	5,2096%

8.12 Qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo fundo e em qual(is) ativo(s) nos últimos 24 (vinte e quatro) meses?

Não é permitido alavancagem.

8.13 Qual o limite para perdas em cenário de stress? Como são definidos os cenários (ex. Utiliza o cenário elaborado pela B³ ou o próprio)?

O fundo não possui limite de Stress.

8.14 Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite de stress foi excedido e por quê?

Não se aplica.

Qual o stress médio do fundo nos últimos:

8.15	3 (três) meses?	N/A
	6 (seis) meses?	N/A
	12 (doze) meses?	N/A
	24 (vinte e quatro) meses?	N/A

8.16 Comente o último stop loss relevante do fundo.

9. Comportamento do fundo em crises

Período*	Evento	Comportamento (variação do fundo)	Explicação
Mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Jul – Ago/07	Crise das hipotecas	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Out/08 – Mar/09	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Abril/11 – Set/11	Segunda crise da dívida na Europa	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Abril/15 – Ago/16	Crise política / recessão no Brasil	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	

* Para o período solicitado deve ser informado o comportamento (variação do fundo) de acordo com o mês fechado (ex. 01/01 a 31/01).

10. Três períodos de maior perda do fundo

Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para recuperação
---------	--------	-------	------------	------------------------

1	26/04/2018 18/06/2018		Fundo: -16,58% Bench: -19,18%		94 Dias
2	16/05/2017 21/06/2017		Fundo: -11,32% Bench: -11,54%		42 Dias
3	31/10/2016 19/12/2016		Fundo: -11,26% Bench: -12,03%		21 Dias

11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos

11.1	Atribuição:	Contribuição:
11.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates). Não houve mudanças.	
11.3	O fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação da gestora, do administrador fiduciário ou órgão regulador? Quando? Por quê? Sim. Por decisão do gestor.	

12. Relacionamento com distribuidores/alocadores

12.1	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores? Por favor consultar seu gerente de relacionamento.
12.2	Com que frequência é possível realizar conference calls com a gestora dos fundos? Os calls podem ser agendados sob demanda com a equipe de Portfolio Specialist.
12.3	Por quais canais o fundo é distribuído? Itaú Unibanco possui um canal próprio de distribuição.
12.4	Considerando o montante total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores distribuidores ou alocadores, individualmente? Informação confidencial.

13. Atendimento aos cotistas

13.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
	Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.
13.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
	Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.
13.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
	SAC Itaú e área de atendimento Asset - Email: atendimentoasset@itau-unibanco.com.br – horário comercial e pelo telefone (11) 3631-2555.

14. Investimento no exterior

14.1	Qual o produto (tipo de ativo ou fundo investido) e sua estrutura, incluindo os veículos utilizados (se houver)? Descreva a estratégia, os principais ativos e instrumentos utilizados.																				
	N/A																				
14.2	Quais os riscos envolvidos?																				
	N/A																				
14.3	Quais são os mercados em que o fundo opera?																				
	N/A																				
14.4	Em relação ao veículo local, o fundo utiliza estratégias para proteção cambial?																				
	N/A																				
14.5	Caso o fundo de investimento local tenha por objetivo o investimento em único fundo de investimento ou veículo no exterior (fundo espelho), enumerar os prestadores de serviços e demais informações dos fundo de investimento ou veículo no exterior (administrador, custodiante, RTA, prime broker, entre outros). <table border="1"> <tr><td>Administrador Fiduciário</td><td></td></tr> <tr><td>Custodiante</td><td></td></tr> <tr><td>Auditor</td><td></td></tr> <tr><td>RTA</td><td></td></tr> <tr><td>Prime Brokers</td><td></td></tr> <tr><td>NAV Calculator</td><td></td></tr> <tr><td>Domicílio do fundo</td><td></td></tr> <tr><td>Taxa de administração</td><td></td></tr> <tr><td>Código ISIN do fundo</td><td></td></tr> <tr><td>Moeda do domicílio fundo no exterior</td><td></td></tr> </table>	Administrador Fiduciário		Custodiante		Auditor		RTA		Prime Brokers		NAV Calculator		Domicílio do fundo		Taxa de administração		Código ISIN do fundo		Moeda do domicílio fundo no exterior	
Administrador Fiduciário																					
Custodiante																					
Auditor																					
RTA																					
Prime Brokers																					
NAV Calculator																					
Domicílio do fundo																					
Taxa de administração																					
Código ISIN do fundo																					
Moeda do domicílio fundo no exterior																					

	Outros prestadores de serviço, dos investimentos no exterior, caso exista.	
14.6	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.	
N/A		
14.7	Caso a gestora tenha influência direta/indireta na gestão do fundo no exterior, descreva como foi constituída a diretoria do fundo.	
N/A		

15. Anexos (quando aplicável)

15	Anexos (quando aplicável)	Marcar Anexos ou link para acesso ao documento
15.1	Regulamento	
15.2	Formulário de informações complementares	
15.3	Última lâmina de informações essenciais	
15.4	Relatório de Gestão e/ou materiais de divulgação	

[LOCAL, DATA]

[ASSINATURA DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO]	[ASSINATURA DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA INSTITUIÇÃO]
[NOME DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO]	[NOME DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA INSTITUIÇÃO]
[CARGO]	[CARGO]
[TELEFONE]	[TELEFONE]
[E-MAIL CORPORATIVO]	[E-MAIL CORPORATIVO]

IGEPREV
Fl. 229
Ass.

REGULAMENTO DO ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
CNPJ – 24.571.992/0001-75

I) CONDIÇÕES ESPECÍFICAS DO FUNDO

1. PRESTADORES DE SERVIÇO

1.1. ADMINISTRADOR

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM nº 990 de 06/07/1989.

1.2. GESTOR

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM nº 990 de 06/07/1989.

1.3. CUSTÓDIA, TESOUREARIA E ESCRITURAÇÃO DE COTAS

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM para a prestação da atividade de custódia de ativos financeiros nº 1.524 de 23/10/1990.

2. PÚBLICO ALVO

O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

2.1. As operações e investimentos deste FUNDO observarão, no que couber, os requisitos, condições, modalidades permitidas e vedações estabelecidos pelas disposições legais, transcritos em regulamento, relativas à aplicação dos recursos das provisões de Entidades Fechadas de Previdência Complementar (EFPC) e dos Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios (RPPS), cabendo aos cotistas que sejam EFPC ou RPPS, 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.

2.2. Os cotistas que sejam EFPC ou RPPS declaram ciência e concordância de que (i) não competirá ao ADMINISTRADOR ou ao GESTOR a operação dos planos previdenciários quer sob o controle de passivo, quer sob a sua respectiva situação econômico-financeira ou pelas obrigações assumidas pelo cotista perante terceiros; e (ii) os nomes do ADMINISTRADOR ou do GESTOR não poderão ser vinculados aos planos de benefício de natureza previdenciária oferecidos pelos cotistas. Adicionalmente, cada EFPC ou RPPS cotista declara-se exclusivamente responsável pela instituição, operação e resultados do plano de benefício de natureza previdenciária por ele constituído, administrado e executado.

3. CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

O FUNDO é constituído como condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração e classificado como “Ações”.

4. POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O objetivo do FUNDO é 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.

4.1. O FUNDO poderá aplicar seus recursos em fundos de investimento que realizem operações com derivativos, desde que tais operações (i) não sejam a descoberto; e (ii) não gerem possibilidade de perda superior ao valor do patrimônio do FUNDO.

4.2. O FUNDO aplica em fundos de investimento que utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

4.3. É vedado ao FUNDO, direta ou indiretamente:

(i) realizar operações denominadas *day trade*, assim consideradas aquelas de compra e venda de um mesmo ativo financeiro ou contrato derivativo em um mesmo dia, exceto nas hipóteses expressamente previstas na regulamentação aplicável;

- (ii) locar, emprestar, tomar emprestado, empenhar ou caucionar ativos financeiros integrantes da carteira do FUNDO, exceto nas hipóteses permitidas pela regulamentação em vigor;
- (iii) realizar operações com ativos financeiros de companhias sem registro na CVM, ressalvados os casos expressamente previstos na legislação vigente;
- (iv) realizar operações com ações por meio de negociações privadas, ressalvadas as hipóteses previstas pela legislação vigente;
- (v) realizar operações com ações de emissão de companhias sem registro para negociação em bolsa de valores ou em mercado de balcão organizado;
- (vi) realizar operações com ações de companhias que não estejam admitidas nos segmentos de negociação permitidos pela regulamentação aplicável a Entidades Fechadas de Previdência Complementar e a Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios;
- (vii) atuar em modalidades operacionais ou negociar com ativos financeiros que não estejam previstos na regulamentação aplicável a Entidades Fechadas de Previdência Complementar e a Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios;
- (viii) aplicar em títulos ou outros ativos financeiros nos quais ente federativo figure como devedor ou preste fiança, aval, aceite ou coobrigação sob qualquer forma;
- (ix) adquirir cotas de Fundo de Investimento em Direitos Creditórios Não Padronizados; e
- (x) negociar cotas de fundos de índice em mercado de balcão.

4.4. Os dados sobre a carteira e as operações do FUNDO poderão ser enviados ao Ministério da Previdência Social, na forma e periodicidade por estes estabelecidas.

4.5. O FUNDO, apenas indiretamente, está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

4.5.1. O gestor do fundo que realiza alocações no exterior é o responsável por executar, na seleção dos ativos financeiros no exterior, procedimentos compatíveis com as melhores práticas do mercado, assegurando que as estratégias a serem implementadas no exterior estejam de acordo com o objetivo, política de investimento e níveis de risco do respectivo fundo.

4.5.2. Os ativos financeiros no exterior devem observar, ao menos, uma das seguintes condições: (i) ser registrados em sistema de registro, objeto de escrituração de ativos, objeto de custódia ou objeto de depósito central, em todos os casos, por instituições devidamente autorizados em seus países de origem e supervisionados por autoridade local reconhecida; ou (ii) ter sua existência diligentemente verificada pelo administrador do fundo que realiza a alocação, e desde que tais ativos sejam escriturados ou custodiados, em ambos os casos, por entidade devidamente autorizada para o exercício da atividade por autoridade de países signatários do Tratado de Assunção ou em outras jurisdições, desde que, neste último caso, seja supervisionada por autoridade local reconhecida.

4.5.3. Caso, indiretamente, sejam realizadas operações de derivativos no exterior ou sejam realizadas alocações em fundos de investimento/ veículos de investimento no exterior, o administrador e o gestor dos fundos que realizarem referidas alocações deverão observar as condições e os requisitos estabelecidos pela ICVM 555/14, de acordo com o público alvo de cada fundo que realizar tais alocações.

4.5.4. As aplicações em ativos financeiros no exterior não são cumulativamente consideradas no cálculo dos correspondentes limites de concentração por emissor e por modalidade de ativo financeiro aplicáveis aos ativos domésticos.

4.6. A descrição detalhada da política de investimento do FUNDO está prevista no Anexo I. Os limites estabelecidos no Anexo I deste regulamento devem ser considerados em conjunto e cumulativamente, prevalecendo a regra mais restritiva. Características adicionais relacionadas ao objetivo do FUNDO também estão previstas no Formulário de Informações Complementares.

5. REMUNERAÇÃO

A taxa de administração é de 1,90% (um vírgula noventa por cento) ao ano, podendo chegar a 2,0% (dois por cento) ao ano sobre o patrimônio do FUNDO em função da taxa de administração dos Fundos Investidos.

5.1. A remuneração prevista acima engloba as taxas de administração dos Fundos Investidos e os pagamentos devidos aos prestadores de serviços do FUNDO, inclusive de custódia, porém não inclui os valores referentes à remuneração do prestador de serviço de auditoria das demonstrações financeiras do FUNDO nem os valores correspondentes aos demais encargos do FUNDO, os quais serão debitados do FUNDO de acordo com o disposto neste Regulamento e na regulamentação.

5.1.1. Serão desconsideradas, para fins de cálculo da taxa de administração do FUNDO, as taxas cobradas por fundos integrantes da carteira do FUNDO, quando se tratar de fundos de índice ou imobiliário, ou ainda, quando geridos por partes não relacionadas ao GESTOR.

5.2. A taxa de administração será provisionada por dia útil, mediante divisão da taxa anual por 252 dias e apropriada mensalmente.

5.3. O ADMINISTRADOR receberá também taxa de performance, equivalente a 20% (vinte por cento) da rentabilidade do FUNDO que exceder a 100% (cem por cento) da variação do Ibovespa, apurado pela BM&FBovespa. A taxa de performance será calculada a partir da valorização dos ativos do FUNDO, provisionada por dia útil como despesa do FUNDO e apropriada no mês subsequente ao encerramento dos meses de junho e dezembro de cada ano, desde que o período não seja inferior a 6 (seis) meses, ou proporcionalmente, na hipótese de resgate.

5.3.1. A taxa de performance somente será devida se o valor da cota do FUNDO ao final de cada período de cálculo for superior ao seu valor na data da última cobrança da taxa de performance ou no início do FUNDO, no caso da primeira cobrança.

5.3.2. Para fins do cálculo da taxa de performance, o valor da cota do FUNDO no momento de apuração do resultado deve ser comparado ao valor da cota, logo após a última cobrança de taxa de performance efetuada ("cota base"), atualizado pelo índice de referência do período transcorrido desde a última cobrança de taxa de performance ou do início do FUNDO, no caso de primeira cobrança.

5.3.3. Caso o valor da cota base atualizada pelo índice de referência seja inferior ao valor da cota base, a taxa de performance a ser provisionada e apropriada deve ser (i) calculada sobre a diferença entre o valor da cota antes de descontada a provisão para a apropriação da taxa de performance e o valor da cota base atualizada pelo índice de referência; e (ii) limitada à diferença entre o valor da cota antes de descontada a provisão para a apropriação da taxa de performance e a cota base.

5.3.4. A taxa de performance será cobrada após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive da taxa de administração.

5.4. O FUNDO não cobra taxa de ingresso ou de saída.

5.5. Os Fundos Investidos podem cobrar taxa de ingresso e/ou de saída de acordo com os seus respectivos regulamentos.

6. APLICAÇÕES

As aplicações ocorrerão mediante: (i) instrução verbal, escrita ou eletrônica (se disponível) ao distribuidor ou diretamente ao ADMINISTRADOR; (ii) adesão aos documentos exigidos pela regulamentação, significando que ele teve acesso ao inteiro teor de tais documentos, conhece os riscos de investir no FUNDO e está ciente de que o ADMINISTRADOR, o GESTOR e empresas ligadas podem manter negócios com emissores de ativos financeiros do FUNDO; e (iii) depósito ou transferência eletrônica do valor do investimento à conta do FUNDO.

6.1. Será admitido o investimento conjunto e solidário por duas pessoas físicas para aquisição de uma mesma cota. Nessa situação os coinvestidores estabelecem entre si a solidariedade ativa, sendo assim considerados em conjunto como um único titular das cotas. Desse modo, cada coinvestidor, isoladamente pode investir e solicitar o resgate, bem como receber resgate, parcial ou total, enfim praticar todo e qualquer ato inerente à propriedade de cotas, ficando o FUNDO e seu ADMINISTRADOR exonerados de responsabilidade no cumprimento de referidas ordens, inclusive ao disponibilizar os recursos a qualquer dos dois cotistas de forma isolada ou conjunta.

6.2. Os recursos aportados serão convertidos em cotas escriturais, nominativas e correspondentes a frações ideais do patrimônio do FUNDO.

6.3. O investidor será considerado cotista a partir da inscrição do seu nome no registro de cotistas, que pode se dar inclusive por meio de sistemas informatizados.

6.4. A cota do FUNDO terá seu valor atualizado nos dias úteis, permanecerá escriturada em nome do cotista e não poderá ser cedida nem transferida, salvo nas situações previstas na regulamentação.

6.5. As aplicações no FUNDO poderão ser suspensas a qualquer momento e por prazo indeterminado.

6.6. Para emissão das cotas, será utilizado o valor da cota de fechamento de D+0 da solicitação (cota de fechamento é aquela obtida a partir do patrimônio apurado depois do encerramento dos mercados em que o FUNDO atue).

6.7. Os valores mínimos para aplicações iniciais e adicionais serão divulgados por meio do formulário de informações complementares, bem como da lâmina de informações essenciais, se houver.

6.7.1. O cotista deverá observar os seguintes limites:

a) valor mínimo para resgate: R\$ 100,00 (cem reais);

b) valor mínimo para permanência no FUNDO: R\$ 100,00 (cem reais); e

c) percentual máximo de cotas que pode ser detido por um único cotista: 100%, exceto se expressamente vedado pela regulamentação aplicável ao cotista do FUNDO.

6.7.2. Pedidos de resgate que resultarem em investimento no FUNDO inferior ao valor mínimo de permanência serão transformados em resgate total.

7. RESGATES

Os resgates ocorrerão mediante:

- (i) instrução verbal, escrita ou eletrônica (se disponível) do cotista ao distribuidor ou diretamente ao ADMINISTRADOR;
- (ii) conversão de cotas em recursos baseada no valor da cota de fechamento de D+21 (úteis) da solicitação; e
- (iii) entrega dos recursos ao cotista em D+2 (úteis) da conversão da cota, sendo que os pedidos de resgate que resultarem em investimento no FUNDO inferior ao valor mínimo de permanência serão transformados em resgate total.

7.1. Os recursos provenientes do resgate serão disponibilizados na conta corrente de titularidade do cotista cadastrada no registro de cotistas do FUNDO, mediante crédito em conta corrente, caso esta seja mantida no Itaú Unibanco, ou transferência eletrônica (com as tarifas incidentes), caso esta seja mantida em outra instituição.

7.2. No caso de fechamento dos mercados e/ou em casos excepcionais de iliquidez dos ativos financeiros do FUNDO, inclusive decorrentes de pedidos de resgates incompatíveis com a liquidez existente, ou que possam implicar alteração do tratamento tributário do FUNDO ou do conjunto dos cotistas, em prejuízo destes últimos, o ADMINISTRADOR pode declarar o fechamento do FUNDO para a realização de resgates.

7.2.1. Caso o ADMINISTRADOR declare o fechamento do FUNDO para a realização de resgates nos termos acima, deve proceder à imediata divulgação de fato relevante, tanto por ocasião do fechamento, quanto da reabertura do FUNDO.

7.2.2. Caso o FUNDO permaneça fechado por período superior a 5 (cinco) dias consecutivos, o ADMINISTRADOR deve obrigatoriamente, além da divulgação de fato relevante por ocasião do fechamento a que se refere o item acima, convocar no prazo máximo de 1 (um) dia, para realização em até 15 (quinze), assembleia geral extraordinária para deliberar sobre as seguintes possibilidades: (i) substituição do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de ambos; (ii) reabertura ou manutenção do fechamento do FUNDO para resgate; (iii) possibilidade do pagamento de resgate em ativos financeiros; (iv) cisão do FUNDO; e (v) liquidação do FUNDO.

8. EXERCÍCIO SOCIAL

O exercício social do FUNDO tem início no primeiro dia do mês de abril e término no último dia do mês de março de cada ano.

II - CONDIÇÕES GERAIS DO FUNDO

1. RISCOS

O objetivo e a política de investimento do FUNDO não constituem promessa de rentabilidade e o cotista assume os riscos decorrentes do investimento no FUNDO, ciente da possibilidade de eventuais perdas.

1.1. A rentabilidade da cota não coincide com a rentabilidade dos ativos financeiros que compõem a carteira do FUNDO em decorrência dos encargos incidentes sobre o FUNDO e dos tributos incidentes sobre os recursos investidos.

1.2. As aplicações realizadas no FUNDO não têm garantia do ADMINISTRADOR, nem do GESTOR e nem do Fundo Garantidor de Créditos.

1.3. Como todo investimento, o FUNDO apresenta riscos, destacando-se:

MERCADO

Os ativos financeiros de titularidade do FUNDO estão sujeitos às oscilações dos mercados em que são negociados. Em especial pelo mercado de ações, que, por sua característica, apresenta-se sujeito a riscos que são originados por fatores que compreendem, mas não se limitam a: (i) fatores macroeconômicos; (ii) fatores de conjuntura política; e (iii) fatores específicos das empresas emissoras destas ações. Estes riscos afetam seus preços e produzem flutuações no valor das cotas do FUNDO, que podem representar ganhos ou perdas para os cotistas.

Os ativos financeiros do FUNDO têm seus valores atualizados diariamente (marcação a mercado) e tais ativos são contabilizados pelo preço de negociação no mercado ou pela melhor estimativa de valor que se obteria nessa negociação, motivo pelo qual o valor da cota do FUNDO poderá sofrer oscilações frequentes e significativas, inclusive num mesmo dia.

A natureza dos riscos de mercado associados ao investimento no exterior e ao investimento no mercado local é similar, mas o comportamento do mercado em outros países e os efeitos provocados na carteira do FUNDO pelos ativos que possuem risco de mercado externo, mesmo que de forma sintetizada no mercado local, podem ser diversos.

O valor dos ativos financeiros do FUNDO pode sofrer variações, em virtude do risco associado à oscilação da taxa de câmbio. Estas oscilações podem valorizar ou desvalorizar as cotas do FUNDO, dependendo da estratégia assumida.

OPERACIONAL

Existe a possibilidade de o valor oficial dos ativos financeiros negociados em mercados internacionais ser disponibilizado em periodicidade, data e/ou horário distintos da utilizada para os ativos financeiros nacionais e para apuração das cotas do FUNDO e dos fundos investidos, seja pelo processo de disponibilização de informações, pelo fuso horário dos mercados, feriados locais, falhas sistêmicas, entre outros. Como consequência, o valor destes ativos será estimado pelo controlador, utilizando-se de fontes públicas de divulgação de cotação de ativos financeiros, método que, apesar de constituir a melhor prática do ponto de vista econômico, não está livre de riscos de (i) imprecisões e aproximações; (ii) no caso de cotas de fundos de investimento, o valor estimado ser distinto do valor oficial divulgado pelo seu administrador ou custodiante no exterior; e (iii) sempre que o valor estimado for distinto do valor real de negociação dos ativos financeiros, o cotista poderá ser beneficiado ou prejudicado no valor de suas cotas, dependendo de a estimativa de valor para o ativo estrangeiro ter sido subavaliada ou superavaliada.

A negociação e os valores dos ativos financeiros do FUNDO podem ser afetados por fatores exógenos diversos, tais como interferências de autoridades governamentais e órgãos reguladores nos mercados, moratórias, alterações da política monetária ou da regulamentação aplicável aos fundos de investimento e/ou a suas operações, podendo, eventualmente, causar perdas aos cotistas. Ademais, o fluxo regular das operações realizadas no mercado internacional pode ser obstado por condições políticas, regulatórias e macroeconômicas dos países envolvidos.

A realização de operações de derivativos pode (i) aumentar a volatilidade do FUNDO, (ii) limitar ou ampliar as possibilidades de retornos, (iii) não produzir os efeitos pretendidos e/ou (iv) determinar perdas ou ganhos aos cotistas do FUNDO. Adicionalmente, ainda que as operações de derivativos tenham objetivo de proteção da carteira contra determinados riscos, não é possível garantir a inexistência de perdas se ocorrerem os riscos que se pretendia proteger.

Apesar dos esforços de seleção, acompanhamento e diligência nas aplicações do FUNDO em outros fundos de investimento, o ADMINISTRADOR e o GESTOR não têm ingerência na condução dos negócios dos fundos investidos e não respondem por eventuais perdas que estes venham a sofrer.

As operações do fundo estão sujeitas a riscos operacionais ligados aos ambientes em que são negociados, tais como: (i) falha de uma determinada bolsa ou fonte de informações; e (ii) interrupção de operações no local de negociação/registro destas, por exemplo, em eventos decorrentes de feriados.

Por motivos e/ou fatores exógenos à vontade do GESTOR, eventos de transferência de recursos ou de títulos podem não ocorrer conforme o previsto. Estes motivos e fatores incluem, por exemplo, inadimplência do intermediário ou das partes, falhas, interrupções, atrasos ou bloqueios nos sistemas ou serviços das centrais depositárias, *clearings* ou sistemas de liquidação, contrapartes centrais garantidoras ou do banco liquidante envolvidos na liquidação dos referidos eventos.

A utilização de modelos para estimar preços de determinados ativos e/ou estimar o comportamento futuro destes ativos, expõe o FUNDO a riscos de imprecisão ou mesmo de diferenças entre preços conforme os prestadores de serviço de controladoria, o que pode resultar em preços diferentes para um mesmo ativo em distintas carteiras no mercado.

CONCENTRAÇÃO

Em função da estratégia de gestão o FUNDO pode se sujeitar ao risco de perdas por não-diversificação de emissores, classes de ativos, mercados, modalidades de operação, ou setores econômicos.

LIQUIDEZ

Dependendo das condições do mercado, os ativos financeiros do FUNDO podem sofrer diminuição de possibilidade de negociação. Nesses casos, o GESTOR poderá, eventualmente, ver-se obrigado a aceitar descontos ou deságios na venda dos ativos (ou de ágio na compra), prejudicando a rentabilidade do fundo.

Apesar do esforço e diligência do Gestor e Administrador em manter a liquidez da carteira do fundo adequada ao prazo de pagamento de resgates, existe o risco de descasamento entre a efetiva liquidez e o prazo para pagamento dos resgates. Isso pode acontecer em função de momentos atípicos de mercado ou por falha em modelo de estimativa de liquidez que se baseia em dados estatísticos e observações de mercado.

Por prever a alocação de recursos em instrumentos com potencial de retorno superior ao de instrumentos tradicionais, porém com potencial de negociabilidade no mercado mais restrita que os instrumentos convencionais, o FUNDO poderá ter que aceitar deságios em relação ao preço esperado de seus instrumentos e com isso impactar negativamente a sua rentabilidade.

CRÉDITO

As operações do FUNDO estão sujeitas à inadimplência ou mora dos emissores dos seus ativos financeiros e contrapartes, inclusive centrais garantidoras e prestadores de serviços envolvidos no trânsito de recursos do FUNDO, caso em que o FUNDO poderá (i) ter reduzida a sua rentabilidade, (ii) sofrer perdas financeiras até o limite das operações contratadas e não liquidadas e/ou (iii) ter desvalorização de parte ou todo o valor alocado nos ativos financeiros.

2. MONITORAMENTO DE RISCOS

São utilizadas no FUNDO técnicas de monitoramento de risco ("monitoramento") para obter estimativa do seu nível de exposição aos riscos acima mencionados, de forma a adequar os investimentos do FUNDO a seus objetivos.

2.1. Os níveis de exposição a risco (i) são definidos em comitês que contam com a participação dos principais executivos das áreas ligadas à gestão de recursos; (ii) são aferidos por área de monitoramento de risco especializada e segregada da mesa de operações; e (iii) podem ser obtidos por meio de uma ou mais das seguintes ferramentas matemático-estatísticas, dependendo dos mercados em que o FUNDO atuar:

(a) monitoramento de alavancagem – alavancagem é a utilização de operações que expõem o FUNDO a mercados de risco em percentual superior ao seu patrimônio, com o consequente aumento dos riscos e da possibilidade de perdas;

(b) VaR – Valor em Risco – estimativa da perda potencial para a carteira do FUNDO, em dado horizonte de tempo, associado a uma probabilidade ou nível de confiança estatístico;

(c) teste de estresse – medida de risco para avaliar o comportamento da carteira do FUNDO em condições significativamente adversas de mercado, baseada em cenários passados, projetados de forma qualitativa ou ainda por métodos quantitativos;

(d) tracking risk – estimativa para medir o risco de o FUNDO não seguir a performance de seu objetivo de investimento;

(e) monitoramento de liquidez – apuração do valor total dos ativos passíveis de liquidação financeira em um determinado prazo, ponderado pelas regras de resgate e pela composição da carteira do FUNDO, atribuindo-se probabilidades para a negociação desses ativos nas condições de mercado vigentes.

2.2. O monitoramento (i) leva em conta as operações do FUNDO; (ii) utiliza dados históricos e suposições para tentar prever o comportamento da economia e, conseqüentemente, os possíveis cenários que eventualmente afetem o FUNDO, mas não há como garantir a precisão desses cenários; e (iii) não elimina a possibilidade de perdas.

2.3. As simulações e estimativas utilizadas no monitoramento dependem de fontes externas de informação, motivo pelo qual o ADMINISTRADOR isenta-se de responsabilidade se tais fontes fornecerem dados incorretos, incompletos ou suspenderem a divulgação dos dados, prejudicando o monitoramento.

3. APURAÇÃO DO VALOR DOS ATIVOS FINANCEIROS DO FUNDO

O valor dos ativos financeiros será apurado, para efeito de cálculo do valor da cota do FUNDO, de acordo com a seguinte metodologia:

(a) ativos financeiros do mercado nacional – diariamente, conforme manual de precificação do controlador, preferencialmente, com base em fontes públicas do mercado nacional;

(b) ativos financeiros do mercado internacional – sempre que possível, será realizada da mesma forma e no mesmo horário que para os ativos financeiros do mercado nacional. Caso os ativos financeiros do mercado internacional não tenham sua cotação diária divulgada até o momento da apuração do valor diário da cota do FUNDO, o valor desses ativos será estimado, preferencialmente, com base em fontes públicas internacionais;

(c) consolidação do valor dos ativos financeiros do FUNDO e dos fundos investidos e determinação do patrimônio global do FUNDO – O valor dos ativos financeiros obtidos nos termos dos itens (a) e (b) acima serão consolidados para fins da apuração do valor global do patrimônio do FUNDO.

4. APLICAÇÕES E RESGATES EM DIAS SEM EXPEDIENTE BANCÁRIO

As aplicações e os resgates solicitados em dias **sem expediente bancário**:

(i) **nacional** serão processadas da seguinte forma: (a) aplicações, no dia útil subsequente em que houver expediente bancário, como se nesse dia fossem solicitados e (b) resgates não poderão ser solicitados;

(ii) **estadual ou municipal**, na praça da conta corrente do cotista, não serão processadas para clientes daquela praça.

4.1. As liquidações de resgates em dias sem expediente bancário nacional, ou ainda, estadual ou municipal, na praça da conta corrente do cotista, ocorrerão no dia subsequente em que houver expediente bancário naquela praça.

4.2. Nas praças onde funcionarem as agências bancárias, nas quais os cotistas mantiverem suas contas correntes, aplicações, resgates e liquidações de resgates serão processados normalmente.

5. ENCARGOS

Constituem encargos do FUNDO: as seguintes despesas, que lhe são debitadas diretamente: (i) taxas, impostos e contribuições que recaiam ou venham a recair sobre os bens, direitos e obrigações do FUNDO; (ii) despesas com o registro de documentos em cartório, impressão, expedição e publicação de relatórios e informações periódicas previstas na regulamentação vigente; (iii) despesas com correspondências de interesse do FUNDO, inclusive comunicações aos cotistas; (iv) honorários e despesas do auditor independente; (v) emolumentos e comissões pagas por operações do FUNDO; (vi) honorários advocatícios, custas e despesas processuais correlatas incorridas na defesa dos interesses do FUNDO, em juízo ou fora dele, inclusive o valor de eventual condenação; (vii) parcela de prejuízos não cobertos por seguros e não decorrentes diretamente de culpa ou dolo dos prestadores de serviços, no exercício de suas respectivas funções; (viii) despesas relacionadas, direta ou indiretamente, ao exercício do direito de voto decorrente de ativos financeiros do FUNDO; (ix) despesas com liquidação, registro e custódia (caso esta não esteja incluída na taxa de administração do FUNDO) de operações com títulos e valores mobiliários, ativos financeiros e modalidades operacionais integrantes da carteira do FUNDO; (x) despesas com fechamento de câmbio, vinculadas às suas operações ou com certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários; (xi) no caso de fundo fechado, a contribuição anual devida às bolsas de valores ou às entidades do mercado organizado em que o FUNDO tenha suas cotas admitidas à negociação, se for o caso; (xii) as taxas de administração e performance, se houver; (xiii) os montantes devidos aos fundos investidores em decorrência de acordos de remuneração, que serão deduzidos da taxa de administração e performance, quando aplicável; e (xiv) honorários e despesas relacionadas à atividade de formador de mercado, se for o caso.

5.1. Quaisquer despesas não previstas como encargos do FUNDO correm por conta do ADMINISTRADOR, devendo ser por ele contratadas.

6. POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO DE RESULTADOS

Os resultados do FUNDO serão automaticamente incorporados ao seu patrimônio.

7. ASSEMBLEIA GERAL

Os cotistas serão convocados: (i) anualmente, até 120 (cento e vinte) dias após o encerramento do exercício social, para deliberação sobre as demonstrações contábeis ou (ii) extraordinariamente, sempre que necessário.

7.1. As assembleias gerais obedecerão as seguintes regras: (i) serão convocadas conforme o(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste regulamento, com antecedência mínima de 10 (dez) dias, dispensada esta formalidade se houver presença total; (ii) serão instaladas com qualquer número de cotistas; (iii) as deliberações serão tomadas por maioria de votos, cabendo 1 (um) voto para cada cota; (iv) poderão votar os cotistas, seus representantes legais ou procuradores constituídos há menos de 1 (um) ano; (v) os cotistas poderão enviar seu voto por meio de comunicação física ou eletrônica, desde que a convocação indique essa possibilidade e estabeleça os critérios para essa forma de voto, que não exclui a realização da reunião de cotistas, no local e horário estabelecidos, cujas deliberações serão tomadas pelos votos dos presentes e dos recebidos pelo(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste regulamento, quando assim admitido na convocação; (vi) a critério do ADMINISTRADOR, que definirá os procedimentos a serem seguidos, as deliberações da assembleia serão tomadas por meio de consulta formal, sem reunião de cotistas, em que a) os cotistas manifestarão seus votos conforme instruções previstas na convocação e b) as decisões serão tomadas com base na maioria dos votos recebidos.

7.1.1. Na hipótese prevista no inciso (v) acima, no caso de não comparecimento físico de cotistas, a assembleia será instalada, sendo a presença dos cotistas caracterizada pelos votos encaminhados antes da realização da assembleia.

7.1.2. Caso a convocação preveja a realização da assembleia por meio eletrônico, os votos dos cotistas relativamente às suas deliberações em assembleia geral deverão ser proferidos mediante a utilização de assinatura eletrônica legalmente reconhecida, sob pena de recusa pelo ADMINISTRADOR.

7.1.3. Na hipótese da não instalação da assembleia geral para deliberação relativa às demonstrações contábeis do FUNDO, em decorrência do não comparecimento de quaisquer cotistas, serão consideradas automaticamente aprovadas caso as demonstrações contábeis não contenham ressalvas.

7.2. O ADMINISTRADOR disponibilizará resumo das deliberações da assembleia geral aos cotistas em até 30 (trinta) dias após a sua realização, conforme o(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste regulamento, o qual também, poderá ser encaminhado juntamente com o extrato.

8. ATOS E FATOS RELEVANTES

Os atos ou fatos relevantes que possam influenciar as decisões de adquirir, alienar ou manter cotas do FUNDO serão imediatamente divulgados aos cotistas por correspondência eletrônica ou outra forma de comunicação disponibilizada pelo ADMINISTRADOR, conforme cláusula específica do regulamento.

9. MEIOS DE COMUNICAÇÃO

O FUNDO utilizará meios físicos ou eletrônicos de comunicação relativamente às suas informações, inclusive no que diz respeito às convocações, deliberações e resumo das assembleias gerais. Nesse sentido, todas as informações ou documentos serão disponibilizados aos cotistas, pelo ADMINISTRADOR, por meio de (i) disponibilização, no endereço eletrônico do ADMINISTRADOR (constante do Formulário de Informações Complementares do FUNDO); (ii) envio de correspondência física; ou (iii) adoção de outra forma de disponibilização, a critério do ADMINISTRADOR, nos termos da regulamentação em vigor. Na hipótese de envio, pelo ADMINISTRADOR, de correspondência física para o endereço de cadastro do cotista, os custos decorrentes deste envio serão suportados pelo FUNDO.

10. FORO

Fica eleito o Foro do domicílio ou da sede do cotista, salvo se o domicílio ou sede do cotista não se situar em território brasileiro, caso em que fica eleito o foro da Capital do Estado de São Paulo.

Para mais informações sobre o FUNDO, consulte o Formulário de Informações Complementares e a Lâmina.

São Paulo - SP, 27 de maio de 2019.

Para mais informações sobre investimentos, fale com o seu gerente ou ligue 4004-4828 (capitais e regiões metropolitanas) ou 0800 970 4828 (demais localidades). Para dúvidas, sugestões e reclamações, se necessário, utilize o SAC Itaú 0800 728 0728, todos os dias, 24h, ou o Fale Conosco (www.itaubr.com.br). Se desejar a reavaliação da solução apresentada após utilizar esses canais, recorra à Ouvidoria Corporativa Itaú Unibanco 0800 570 0011, dias úteis, das 9 às 18h, Caixa Postal nº 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala 0800 722 1722, disponível 24h todos os dias.

ANEXO I – DESCRIÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

LIMITES POR ATIVO (% do patrimônio do FUNDO)			
Legislação		Fundo	Descrição dos Ativos Financeiros
GRUPO I – No mínimo 95%	Até 100%	Permitido	FI e FIC registrados com base na Instrução CVM 555/14, classificados como Ações.
	Até 100%	Permitido	Cotas de fundos de investimento cuja política assegure que o patrimônio esteja investido em ativos que acompanham índices de renda variável, divulgados por bolsa de valores no Brasil, compostos por, no mínimo, cinquenta ações, correspondentes bônus ou recibos de subscrição e de certificados de depósitos de tais ações, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de Índice de renda variável) (Fundos de Índice de Ações)
	Até 20%	Permitido	FI e FIC registrados com base na Instrução CVM 555/14, destinados a investidores qualificados e classificados como Ações.
		Vedado	FI e FIC registrados com base na Instrução CVM 555/14, destinados a investidores profissionais e classificados como Ações.
	Até 20%	Permitido	<u>Investimento no Exterior</u> : ativos no exterior detidos de forma indireta e consolidada, por meio da aquisição de cotas de fundos de investimento constituídos no Brasil que invistam no exterior, além de cotas de fundos de índice referenciados em índices estrangeiros e cotas de fundos de investimento registrado com base na Instrução CVM 555/14 que possuam em sua denominação o sufixo "Investimento no Exterior", desde que compatíveis com a política do FUNDO e observada a regulamentação em vigor e as disposições deste Regulamento.
GRUPO II – Até 5%		Permitido	Títulos públicos federais.
		Permitido	Títulos de renda fixa de emissão de instituições financeiras.
		Permitido	Operações compromissadas.
		Permitido	Cotas de fundos de investimento em índices de Renda Fixa (Fundos de Índice).
		Permitido	Cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa em suas modalidades: Curto Prazo, Simples e Referenciado (DI ou Selic)*.

*Este limite será consolidado com os investimentos em cotas de FI e FIC destinados a investidores qualificados e/ou profissionais, indicado no Grupo I. Se o Grupo I vedar o investimento em cotas de FI e FIC destinados a investidores qualificados e/ou profissionais, tal investimento também será vedado para as cotas de FI e FIC previstas no Grupo II.

LIMITES POR EMISSOR (% do patrimônio do FUNDO)		
Legislação	Fundo	Emissor
Até 100%	Permitido	Fundo de investimento
Até 5%	Permitido	Instituição financeira autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil
	Vedado	Companhia aberta
	Vedado	Pessoa física ou jurídica de direito privado que não seja companhia aberta ou instituição financeira autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil

Este FUNDO pode estar exposto, direta ou indiretamente, a significativa concentração em ativos financeiros de renda variável de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.

DERIVATIVOS	
Hedge e posicionamento	Limitado a uma vez o patrimônio

Este FUNDO poderá aplicar em fundos de investimento que utilizam estratégias com derivativos como parte integrante de suas respectivas políticas de investimento.

(% do patrimônio do FUNDO)	
Até 100%	Contraparte ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas, inclusive veículos de investimento por eles administrados ou geridos.
Até 5%	Ativos financeiros de renda fixa emitidos pelo ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas.
Até 100%	Cotas de fundos de investimento administrados pelo ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas.

Objetivos do Fundo

Fundo de ações de retorno absoluto. Foco em análise fundamentalista com visão Internacional sobre a bolsa brasileira.

Estratégia conta com robusta análise bottom-up, avaliando os fundamentos, saúde financeira da empresa, preço justo e posicionamento dos agentes de mercado. O Portfólio da estratégia é concentrado, com cerca de 20 ações, sem restrição de market-cap e alocação tática em caixa.

Análise de Retorno

35,76 %

Rentabilidade nominal dos últimos 12 meses

13,11 % + Benchmark

Rentabilidade relativa ao benchmark dos últimos 12 meses

32,51 % + Benchmark

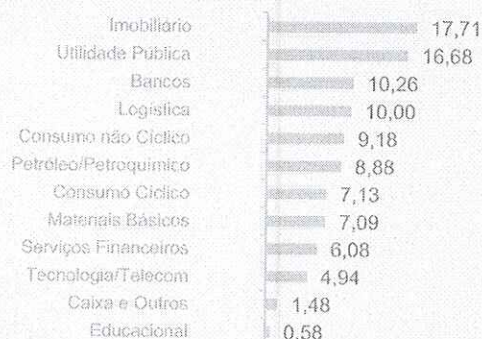
Rentabilidade relativa ao benchmark desde o início do fundo (12/09/2016)

Termômetro de Risco



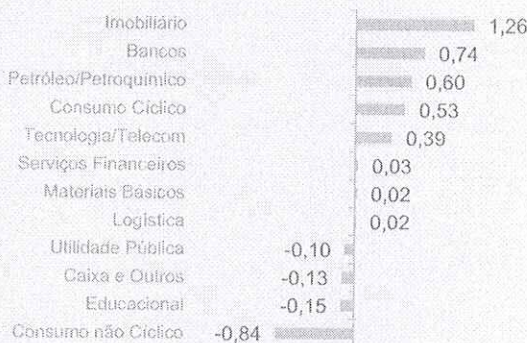
Alocação média setorial no mês

% da carteira



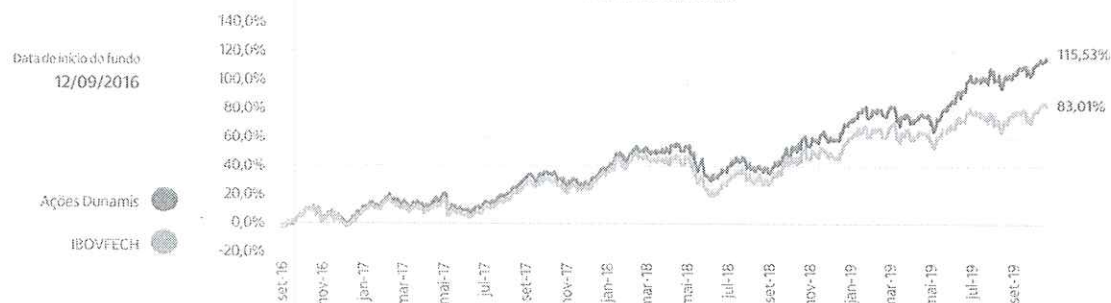
Contribuição Setorial no Mês

Retorno em %



Retorno acumulado

(Acumulado desde o início)



Retorno Mensal

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2019	Fundo	10,29%	-1,26%	-1,68%	1,28%	1,62%	7,22%	3,75%	1,57%	3,42%	2,38%	-	-	31,84%
	+/- Bench	-0,52%	0,60%	-1,51%	0,30%	0,92%	3,17%	2,91%	2,23%	-0,15%	0,02%	-	-	9,85%
2018	Fundo	11,59%	0,83%	0,63%	2,96%	-10,04%	-3,38%	5,89%	-2,88%	3,15%	10,67%	3,00%	-0,03%	22,48%
	+/- Bench	0,45%	0,31%	0,62%	2,08%	0,83%	1,82%	-2,98%	0,33%	-0,32%	0,48%	0,62%	1,78%	7,44%
2017	Fundo	7,52%	3,34%	-2,05%	1,35%	-4,44%	0,64%	4,63%	7,82%	4,70%	0,54%	-3,75%	5,26%	27,63%
	+/- Bench	0,14%	0,26%	0,47%	0,71%	-0,33%	0,34%	-0,18%	0,36%	-0,18%	0,52%	-0,60%	-0,90%	0,77%

37

Meses desde o início do fundo

71%

Meses em que esteve acima do benchmark

68%

Meses de retorno positivo do fundo

17,32%

Volatilidade 12 Meses

Assim como em setembro, o mês de outubro foi de valorização dos principais índices do mercado acionário. As altas do Ibovespa e do IBRX foram de, respectivamente, 2,36% e 2,20%.

Apesar das incertezas com o cenário de crescimento mundial, o abrandamento das disputas comerciais entre americanos e chineses reduziu o sentimento de aversão ao risco. Além disso, no Brasil, a perspectiva de queda dos juros básicos e de reativação da economia fortalecem a visão de crescimento dos lucros para as companhias listadas nos próximos anos.

No Ibovespa, destaque positivo para o desempenho das ações do setor imobiliário e financeiro. Por outro lado, os setores industrial e de materiais básicos foram os negativos. Na estratégia Dunamis, as maiores alocações absolutas médias do mês foram nos setores imobiliário, de utilidade pública e bancário. Do lado da performance, os destaques positivos vieram de nossas alocações em empresas dos setores imobiliário, bancário e de petróleo. Já do lado negativo, as posições em empresas de consumo não cíclico, do setor de educação e de utilidade pública foram responsáveis por perdas no mês.

Características

Volume Global Mínimo*
R\$ 100,00

Classificação Tributária
Renda Variável

Patrimônio Líquido Médio nos últimos 12 meses
R\$ 1.638.733.718,14

Clique aqui para investir

Taxa de Administração
2,00% ao ano

Taxa de Performance
20% do que exceder 100% do
IBOVESPA FECHAMENTO.

Público Alvo
Público Em Geral

Horário para Movimentação
Até às 15:00

Aplicação e Resgate
Cota de aplicação: D+0
Cota de resgate (dias úteis): D+21
Crédito do resgate (dias úteis): D+23

Acesse outros documentos relevantes deste fundo: www.itaú.com.br/investimentos-previdencia/fundos/informacoes-cotistas/

Glossário: LF - Letra Financeira; CDB - Certificado de Depósito Bancário; LSF - Letra Financeira Subordinada; LFSN - Letra Financeira Elegível - Nível II; DEB - Debêntures; NP - Notas Promissórias; CCB - Cédula de Crédito Bancário; FIDC - Fundo de Investimento em Direitos Creditórios; DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial; Debêntures Conversível; Certificado de Recebíveis Imobiliários; LC - Letra de Câmbio; LCA - Letra de Crédito Agrícola; LCI - Letra de Crédito Imobiliário; DEB COMP - Debênture Compromissada; CDB Vinc - Certificado de Depósito Interbancário Vinculado; CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários; CDCA - Certificado de Direitos Creditórios do Agronegócio; CPR - Contas a Pagar e Receber; DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial; COMP - Operação Compromissada; LH - Letra Hipotecária; TERMO - Contrato a Termo.

Informações relevantes

ITAU AÇÕES DUNAMIS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - CNPJ 24.571.992/0001-75 - 31/10/2019

Este fundo possui lâmina de informações essenciais, podendo esta ser consultada no seguinte endereço eletrônico www.itaú.com.br. Os rendimentos serão tributados no momento do resgate, à alíquota de 15%. Público alvo: O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A. Objetivo do fundo: Proporcionar retorno por meio da aplicação em outros fundos de investimento que aloquem em ações de companhias abertas com potencial de valorização e perspectiva de retorno em longo prazo.. Tipo Anbima: AÇÕES LIVRE. Início do fundo em: 12/09/2016. Taxa de Administração máx.: 2,00%. Taxa de Performance: 20% do que exceder 100% do IBOVESPA FECHAMENTO. Fonte de dados do material: Itaú Asset Management.

Material de divulgação do fundo - A Itaú Asset Management é o segmento do Itaú Unibanco especializado em gestão de recursos de clientes. Leia a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Para obter mais informações, entre em contato pelo telefone (11) 3631-2555. Consultas, sugestões, reclamações, críticas, elogios e denúncias, utilize o SAC: 0800 725 0728, todos os dias, 24 horas, ou o canal Fale Conosco (www.itaú.com.br). Se necessário contate a Ouvidoria Corporativa Itaú: 0800 570 0011 (em dias úteis das 9h às 18h) ou Caixa Postal 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, todos os dias, 24 horas, 0800 722 1222.



Outras informações relevantes

* O Itaú PersonalIt considerará seu volume global de investimentos, ou seja, a soma dos valores já investidos em CDB, operações compromissadas, poupança, previdência, fundos e Itaú Corretora, como valor mínimo para a entrada em novos investimentos. Para outros segmentos do Itaú Unibanco, o volume global é correspondente ao valor mínimo de aplicação.

10/2019

Nome do Fundo: ITAU AÇÕES DINAMIS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

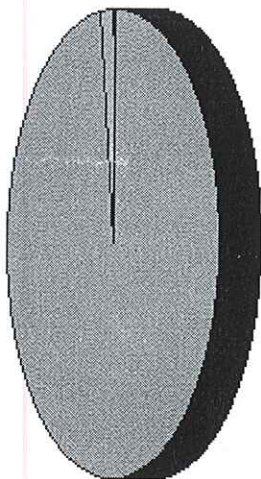
Administrador: ITAU UNIBANCO S.A.

Versão: 4.0

CNPJ: 24.571.992/00
01-75
CNPJ: 60.701.190/00
01-04

Data de
Recebimento das
Informações: 07/11/2
019.02.26.00

3.810.249.538,25 Cotas de Fundos
39.570.834,44 Valores a pagar
3.504.990,12 Valores a receber
10.000,00 Disponibilidades



Ativo	Classificação	Empresa Ligada	Vendas		Aquisições		Quant.	Valores		% Patr. Liq.
			Quant.	Valor	Quant.	Valor		Custo	Mercado	
Cotas de Fundos										
ITAÚ DINAMIS MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		Não	0	0	0	0	151.963.320		3.801.765.428,82	100,731
Cotas de Fundos										
ITAÚ CAIXA AÇÕES - FUNDO DE INVESTIMENTO		Não	0	0	0	0	199.190		8.484.109,43	0,225
Disponibilidades	Para									
Descrição: DISPONI- BILIDADES	negociação								10.000,00	0
Valores a pagar	Para									
Descrição: VALORE S A PAGAR	negociação								39.570.834,44	-1,048
Valores a receber	Para									
Descrição: VALORE S A RECEBER	negociação								3.504.990,12	0,093

Posição Final

PARECER DINVEST Nº 011/2019

CREDENCIAMENTO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

NOME DO FUNDO:	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FICFI
CNPJ nº	24.571.922/0001-75
OBJETIVO:	Credenciamento
PROCESSO Nº	2018/24830/002656

Análise da Documentação

A partir da análise dos documentos apresentados pelo gestor e consulta às instituições reguladoras a Diretoria de Investimentos do Igeprev-TO (DINVEST), conclui os seguintes pontos quanto ao Fundo de Investimento:

1- Prestadores de serviço:

1.1. Administrador

Nome: ITAÚ UNIBANCO S.A.

CNPJ: 60.701.190/0001-04

Status: Credenciado

Vigência: 09/06/2020

Nr. Processo: 2018/24830/002656

1.2. Gestor

Nome: ITAÚ UNIBANCO S.A.

CNPJ: 60.701.190/0001-04

Status: Credenciado

Vigência: 09/06/2020

Nr. Processo: 2018/24830/002656

1.3. Distribuidor: ITAÚ UNIBANCO S.A., exclusivamente através de sua rede de agências.

1.4. Custodiante: ITAÚ UNIBANCO S.A.

1.5. Auditor Independente: Price Waterhouse Coopers

1.6. Segmento de Mercado: Fundo de Ações

2- Fundo consta da lista de fundos vedados? Não. Consulta em 02/12/2019.

3- Documentos analisados: QDD, Lâmina, Regulamento, Carteira CVM.

3.1. Data de abertura / idade do fundo: 21/07/2016 – 3 anos

3.2. Objetivo do fundo: Proporcionar retorno por meio da aplicação em outros fundos de investimento que alocam em ações de companhias abertas com potencial de valorização e perspectiva de retorno em longo prazo.

3.3. Público alvo: O fundo, a critério do administrador, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do administrador, do gestor ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

3.4. Tipo de condomínio: Aberto.

3.5. Quantidade de cotistas: 57,2 mil

3.6. Benchmark: Ibovespa.

3.7. Política de investimento: 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.

3.8. Principais categorias de ativos e fundos:

Cotas de Fundos:	
ITAU DUNAMIS MASTER FIA	R\$ 3.801.765.428,82
ITAU CAIXA AÇÕES FI	R\$ 8.484.109,43
Disponibilidades	R\$ 10.000,00
Operações Compromissadas	R\$ 0,00
Títulos Públicos	R\$ 0,00

3.9. Patrimônio Líquido: R\$ 3.323.316.169,21 (30/08/2019 - QDD)

3.10. Aplicação mínima: R\$ 100,00

3.11. Pagamento do resgate: 23 dias úteis contados da data do pedido de resgate.

3.12. Taxas:

Entrada/Saída: 0% **Administração:** 1,9% a.a. **Gestão:** Não Informado
Custódia: Não há. **Performance:** 20% da rentabilidade do FUNDO que exceder a 100% (cem por cento) da variação do Ibovespa

4- Rentabilidade:

ANO	RENTABILIDADE (LÍQUIDA DE DESPESAS, MAS NÃO DE IMPOSTOS)	VARIAÇÃO PERCENTUAL DO ÍNDICE DE REFERÊNCIA [IDIV11]	DESEMPENHO DO FUNDO COMO % DO ÍNDICE DE REFERÊNCIA [IDIV11]
2019	31,84%	22%	9,85%
2018	22,48%	15,03%	7,44%
2017	27,63%	26,86%	0,77%
2016	4,58%	2,8%	1,78%

RENTABILIDADE MENSAL : A RENTABILIDADE DO FUNDO NOS ÚLTIMOS 12 MESES FOI:			
MÊS	RENTABILIDADE (LÍQUIDA DE DESPESAS, MAS NÃO DE IMPOSTOS)	VARIAÇÃO PERCENTUAL DO ÍNDICE DE REFERÊNCIA [IDIV11]	DESEMPENHO DO FUNDO COMO % DO ÍNDICE DE REFERÊNCIA [IDIV11]
10	2,38%	2,36%	0,02%
9	3,42%	3,57%	-0,15%
8	1,57%	-0,67%	2,23%
7	3,75%	0,84%	2,91%
6	7,22%	4,06%	3,17%
5	1,62%	0,70%	0,92%
4	1,28%	0,98%	0,30%
3	-1,68%	-0,18%	-1,51%
2	-1,26%	-1,86%	0,60%
1	10,29%	10,82%	-0,52%
12	-0,03%	-1,81%	1,78%
11	3%	2,38%	0,62%

Rentabilidade Underwater Volatilidade Correlação

CDI

Ibovespa

Diário

Máxima

1 ano

2 anos

3 anos

Personalizado



■ IBOVESPA	Rentab. absoluta: 21,33%	Rentab. relativa: 0,00 p.p.	Consistência: N/A	Sharpe (risco/retorno): N/A	Risco: 18,39%	
■ ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Rentab. absoluta: 35,63%	Rentab. relativa: 14,30 p.p.	Consistência: N/A	Sharpe (risco/retorno): 0,85	Risco: 16,77%	 
■ CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Rentab. absoluta: 37,21%	Rentab. relativa: 15,88 p.p.	Consistência: N/A	Sharpe (risco/retorno): 1,01	Risco: 15,75%	 
■ SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO DIVIDENDOS TOP ACOES	Rentab. absoluta: 29,14%	Rentab. relativa: 7,81 p.p.	Consistência: N/A	Sharpe (risco/retorno): 0,49	Risco: 15,92%	 
■ BB TOP AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Rentab. absoluta: 35,72%	Rentab. relativa: 14,38 p.p.	Consistência: N/A	Sharpe (risco/retorno): 0,81	Risco: 17,67%	 

Quando avaliamos a rentabilidade do Fundo Itaú Ações Dunamis FICF fica acima do Ibovespa nos últimos 12 meses, apresenta bom resultados comparando com os outros apresentados acima. Em linhas gerais, a Dininvest viu com bons olhos e opta pelo credenciamento para uma posterior possibilidade de aplicação.

5- Conclusão da análise

Trata-se de credenciamento de fundo de investimento em atendimento ao que dispõe a Resolução CMN 3.922/10 e Resolução 519/11 do Ministério de Previdência Social.

Conforme observado no Questionário *Due Diligence* – QDD Anexo 1 apresentado pela gestora, bem como na Lâmina e Regulamento do fundo consultado na página da Comissão de Valores Mobiliários – CVM, o fundo possui bons resultados de rentabilidade/risco.

Acrescenta-se, ainda, que uma aplicação no fundo atende às indicações de cenários avaliados para final de 2019 e o exercício de 2020.

Isto posto, recomenda-se o envio dos autos ao Comitê de Investimentos para deliberação quanto deferimento do credenciamento do novo fundo.

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIÁRIA DO ESTADO DO TOCANTINS, em Palmas, 06 dias do mês de dezembro do ano de 2019.

(assinado eletronicamente)
JÚLIO CÉSAR MEDEIROS LIMA
Gerente de Controle e Análise de Risco

(assinado eletronicamente)
REYNALDO FERREIRA DE MELO
Diretor de Investimentos

I) CONDIÇÕES ESPECÍFICAS DO FUNDO

1. PRESTADORES DE SERVIÇO

1.1. ADMINISTRADOR

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM nº 990 de 06/07/1989.

1.2. GESTOR

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM nº 990 de 06/07/1989.

1.3. CUSTÓDIA, TESOURARIA E ESCRITURAÇÃO DE COTAS

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM nº 990 de 06/07/1989

PÚBLICO ALVO

O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento, pessoas físicas e/ou jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

2.1. 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 às 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 de seus recursos estabelecidos pela regulamentação que lhe seja aplicável a tais entidades.

2.2. Os cotistas que sejam RPPS ou EFPC, declaram que têm ciência, bem como darão ciência aos contratantes e participantes dos planos de benefício de natureza previdenciária cujos recursos e provisões técnicas venham a ser investidos no FUNDO de que (i) não competirá ao ADMINISTRADOR ou ao GESTOR a operação dos planos previdenciários quer sob o controle de passivo, quer sob a sua respectiva situação econômico-financeira; e (ii) os nomes do ADMINISTRADOR ou do GESTOR não poderão ser vinculados ao planos de benefício de natureza previdenciária, mas poderão ser citados na qualidade de administrador ou gestor do FUNDO. Adicionalmente, cada RPPS ou EFPC cotista do FUNDO declara-se exclusivamente responsável pela instituição, operação e resultados do plano de benefício de natureza previdenciária por ela constituído, administrado e executado.

3. CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

O FUNDO é constituído como condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração e classificado como “renda fixa”.

4. POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O objetivo do FUNDO é 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.

4.1. O FUNDO, direta ou indiretamente, somente poderá adquirir ativos financeiros cujo emissor ou emissão, conforme o caso, esteja classificado na categoria de baixo risco de crédito, com base dentre outros critérios em classificação efetuada por agência de classificadora de risco em funcionamento no país.

4.2. O FUNDO aplica em fundos de investimento que utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

4.3. O FUNDO poderá realizar operações com derivativos, desde que tais operações (i) não sejam a descoberto; e (ii) não gerem possibilidade de perda superior ao valor do patrimônio do FUNDO.

4.4. Nas operações do FUNDO em mercados de derivativos, serão observados, ainda, os seguintes limites com relação à posição do FUNDO em títulos da dívida pública mobiliária federal e ativos financeiros de emissão de instituição financeira autorizada a funcionar pelo BACEN: (i) no máximo 15% (quinze por cento) podem ser utilizados como depósito de margem em tais operações; e (ii) no máximo 5% (cinco por cento) podem ser utilizados para pagamento de prêmios de opções.

4.5. É vedado ao FUNDO, direta ou indiretamente:

(i) realizar operações denominadas *day trade*, assim consideradas aquelas de compra e venda de um mesmo ativo financeiro ou contrato derivativo em um mesmo dia, exceto nas hipóteses expressamente previstas na regulamentação aplicável;

(ii) aplicar em ativos financeiros que ente federativo figure como devedor ou preste fiança, aval, aceite ou coobrigação sob qualquer forma;

(iii) adquirir cotas de Fundo de Investimento em Direitos Creditórios Não Padronizados;

(iv) locar, emprestar, tomar emprestado, empenhar ou caucionar ativos financeiros integrantes da carteira do FUNDO, exceto nas hipóteses permitidas pela regulamentação em vigor;

(v) realizar operações com ativos financeiros de companhias sem registro na CVM, ressalvados os casos expressamente previstos na legislação vigente; e

(vi) atuar em modalidades operacionais ou negociar com ativos financeiros que não estejam previstos na regulamentação aplicável a Entidades Fechadas de Previdência Complementar.

4.6. A descrição detalhada da política de investimento do FUNDO, está prevista no Anexo I. Os limites estabelecidos no Anexo I deste regulamento devem ser considerados em conjunto e cumulativamente. Características adicionais relacionadas ao objetivo do FUNDO também estão previstas no formulário de informações complementares.

5. REMUNERAÇÃO

A taxa de administração, fixa e anual, é de 0,50% (zero vírgula cinquenta por cento) sobre o patrimônio do FUNDO.

5.1. A remuneração prevista acima engloba as taxas de administração dos fundos investidos e os pagamentos devidos aos prestadores de serviços do FUNDO, inclusive de custódia, porém não inclui os valores referentes à remuneração do prestador de serviço de auditoria das demonstrações financeiras do FUNDO nem os valores correspondentes aos demais encargos do FUNDO, os quais serão debitados do FUNDO de acordo com o disposto neste regulamento e na regulamentação.

5.1.1. Serão desconsideradas, para fins de cálculo da taxa de administração do FUNDO, as taxas cobradas por fundos integrantes da carteira do FUNDO, quando se tratar de fundos de índice ou imobiliário, ou ainda, quando geridos por partes não relacionadas ao GESTOR.

5.2. A taxa de administração será provisionada por dia útil, mediante divisão da taxa anual por 252 dias, apropriada e paga mensalmente.

5.3. O FUNDO não cobra taxa de performance, de ingresso ou de saída.

5.4. Considera-se patrimônio a soma algébrica do disponível com o valor da carteira, mais os valores a receber, menos as exigibilidades.

5. Os fundos investidos podem cobrar taxa de performance, ingresso e/ou de saída, de acordo com os seus respectivos regulamentos.

6. APLICAÇÕES

As aplicações ocorrerão mediante: (i) instrução verbal, escrita ou eletrônica (se disponível) ao distribuidor ou diretamente ao ADMINISTRADOR; (ii) adesão do investidor aos documentos exigidos pela regulamentação vigente, significando que ele teve acesso ao inteiro teor de tais documentos, conhece os riscos de investir no FUNDO e está ciente de que o ADMINISTRADOR, o GESTOR e empresas ligadas podem manter negócios com emissores de ativos financeiros do FUNDO; e (iii) depósito ou transferência eletrônica do valor do investimento à conta do FUNDO.

6.1. Os recursos destinados à aplicação serão convertidos em cotas escriturais, nominativas e correspondentes a frações ideais do patrimônio do FUNDO.

6.2. A qualidade de cotista será caracterizada pela inscrição do nome do investidor no registro de cotistas, que pode se dar inclusive por meio de sistemas informatizados.

6.3. A cota do FUNDO terá seu valor atualizado nos dias úteis, será mantida escriturada em nome do cotista e não poderá ser cedida nem transferida, salvo por decisão judicial ou arbitral, operações de cessão fiduciária, execução de garantia, sucessão universal, dissolução de sociedade conjugal ou união estável por via judicial ou escritura pública que disponha sobre a partilha de bens e transferência de administração ou portabilidade de planos de previdência.

6.4. As aplicações no FUNDO poderão ser suspensas a qualquer momento e por prazo indeterminado.

6.5. Para emissão das cotas, será utilizado o valor da cota de fechamento de D+0 da solicitação (cota de fechamento é aquela obtida a partir do patrimônio apurado depois do encerramento dos mercados em que o FUNDO atue)

6.6. Os valores mínimos para aplicações iniciais e adicionais serão divulgados por meio do formulário de informações complementares, bem como da lâmina de informações essenciais, se houver.

6.7. O cotista deverá observar os seguintes limites:

a) valor mínimo para resgate: não há;

b) valor mínimo para permanência no FUNDO: R\$ 1.000,00 (hum mil reais); e

c) percentual máximo de cotas que pode ser detido por um único cotista: 100%, exceto se expressamente vedado pela regulamentação aplicável ao cotista do FUNDO.

6.7.1. Pedidos de resgate que resultarem em investimento no FUNDO inferior ao mínimo para permanência acima estabelecido serão automaticamente transformados em resgate total.



7. RESGATES

Os resgates ocorrerão mediante:

(i) instrução verbal, escrita ou eletrônica (se disponível) do cotista ao distribuidor ou diretamente ao ADMINISTRADOR;

(ii) conversão de cotas em recursos levando-se em consideração o valor da cota de fechamento de D+0 da solicitação; e

(iii) entrega dos recursos ao cotista em D+1 (útil) da conversão da cota, sendo que os pedidos de resgate que resultarem em investimento no FUNDO inferior ao mínimo estabelecido serão transformados em resgate total.

7.1. Os recursos provenientes do resgate serão disponibilizados ao cotista na conta corrente de sua titularidade cadastrada no registro de cotistas do FUNDO, mediante crédito em conta corrente, caso esta seja mantida no Itaú Unibanco, ou transferência eletrônica (com as tarifas incidentes), caso esta seja mantida em outra instituição.

7.2. No caso de fechamento dos mercados e/ou em casos excepcionais de iliquidez dos ativos financeiros do FUNDO, inclusive decorrentes de pedidos de resgates incompatíveis com a liquidez existente, ou que possam implicar alteração do tratamento tributário do FUNDO ou do conjunto dos cotistas, em prejuízo destes últimos, o ADMINISTRADOR pode declarar o fechamento do FUNDO para a realização de resgates.

7.3. Caso o ADMINISTRADOR declare o fechamento do FUNDO para a realização de resgates nos termos acima, deve proceder à imediata divulgação de fato relevante, tanto por ocasião do fechamento, quanto da reabertura do FUNDO.

7.4. Caso o FUNDO permaneça fechado por período superior a 5 (cinco) dias consecutivos, o ADMINISTRADOR deve obrigatoriamente, além da divulgação de fato relevante por ocasião do fechamento a que se refere o item acima, convocar no prazo máximo de 1 (um) dia, para realização em até 15 (quinze), assembleia geral extraordinária para deliberar sobre as seguintes possibilidades: (i) substituição do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de ambos; (ii) reabertura ou manutenção do fechamento do FUNDO para resgate; (iii) possibilidade do pagamento de resgate em ativos financeiros; (iv) cisão do FUNDO; e (v) liquidação do FUNDO.

8. EXERCÍCIO SOCIAL

O exercício social do FUNDO tem início no primeiro dia do mês de dezembro e término no último dia do mês de novembro de cada ano.

II - CONDIÇÕES GERAIS DO FUNDO



1. RISCOS

O objetivo e a política de investimento do FUNDO não constituem promessa de rentabilidade e o cotista assume os riscos decorrentes do investimento no FUNDO, ciente da possibilidade de eventuais perdas.

1.1. A rentabilidade da cota não coincide com a rentabilidade dos ativos financeiros que compõem a carteira do FUNDO em decorrência dos encargos incidentes sobre o FUNDO e dos tributos incidentes sobre os recursos investidos.

1.2. As aplicações realizadas no FUNDO não têm garantia do ADMINISTRADOR, nem do GESTOR e nem do Fundo Garantidor de Créditos.

1.3. Como todo investimento, o FUNDO apresenta riscos, destacando-se:

MERCADO

Em função de sua Política de Investimentos e da estratégia perseguida pelo FUNDO, os ativos financeiros estão sujeitos às oscilações dos mercados em que são negociados. Em especial pelos mercados de taxas de juros e índices de preços, que, por suas características, apresentam-se sujeitos a riscos que são originados por fatores que compreendem, mas não se limitam a: (i) fatores externos; (ii) fatores macroeconômicos; e (iii) fatores de conjuntura política. Estes riscos afetam seus preços e produzem flutuações no valor das cotas do FUNDO, que podem representar ganhos ou perdas para os cotistas.

Os ativos financeiros do FUNDO têm seus valores atualizados diariamente (marcação a mercado) e tais ativos são contabilizados pelo preço de negociação no mercado ou pela melhor estimativa de valor que se obteria nessa negociação, motivo pelo qual o valor da cota do FUNDO poderá sofrer oscilações frequentes e significativas, inclusive num mesmo dia.

OPERACIONAL

A negociação e os valores dos ativos financeiros do FUNDO podem ser afetados por fatores exógenos diversos, tais como interferências de autoridades governamentais e órgãos reguladores nos mercados, moratórias, alterações da política monetária ou da regulamentação aplicável aos fundos de investimento e/ou a suas operações, podendo, eventualmente, causar perdas aos cotistas.

A realização de operações de derivativos pode (i) aumentar a volatilidade do FUNDO, (ii) limitar ou ampliar as possibilidades de retornos, (iii) não produzir os efeitos pretendidos e/ou (iv) determinar perdas ou ganhos aos cotistas do FUNDO. Adicionalmente, ainda que as operações de derivativos tenham objetivo de proteção da carteira contra determinados riscos, não é possível garantir a inexistência de perdas se ocorrerem os riscos que se pretendia proteger.

Apesar dos esforços de seleção, acompanhamento e diligência nas aplicações do FUNDO em outros fundos de investimento, o ADMINISTRADOR e o GESTOR não têm ingerência na condução dos negócios dos fundos investidos e não respondem por eventuais perdas que estes venham a sofrer.

Ao buscar tratamento fiscal mais benéfico ao cotista, investindo em ativos financeiros com prazos de vencimentos mais longos (carteira longa), o FUNDO, em momentos de instabilidade no mercado, expõe o seu patrimônio a maior oscilação, se comparado a fundos que investem preponderantemente em ativos financeiros com prazo de vencimento mais curto (carteira curta).

Para possibilitar o benefício das alíquotas decrescentes de IRF concedidas aos cotistas de fundos classificados como Longo Prazo, conforme previsto na legislação, o GESTOR buscará manter a carteira do FUNDO com prazo médio superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. Todavia, caso este objetivo não seja atingido, haverá alteração do tratamento tributário dos cotistas e consequente pagamento de IRF com alíquotas mais altas (22,50% para aplicações até 180 dias e 20,0% para aplicações com prazo superior à 180 dias).

Há risco de alteração da metodologia do índice utilizado como referência pelo FUNDO. Há, ainda, risco de término de sua divulgação, caso em que o ADMINISTRADOR convocará assembleia para determinar o tratamento do impacto no FUNDO.

As operações do fundo estão sujeitas a riscos operacionais ligados aos ambientes em que são negociados, tais como: (i) falha de uma determinada bolsa ou fonte de informações; e (ii) interrupção de operações no local de negociação/registo destas, por exemplo, em eventos decorrentes de feriados.

Por motivos e/ou fatores exógenos à vontade do GESTOR, eventos de transferência de recursos ou de títulos podem não ocorrer conforme o previsto, mesmo em situações em que não tenha ocorrido inadimplemento pelos respectivos emissores ou contrapartes. Estes motivos e fatores incluem, por exemplo, inadimplência do intermediário ou das partes, falhas, interrupções, atrasos ou bloqueios nos sistemas ou serviços das centrais depositárias, *clearings* ou sistemas de liquidação, contrapartes centrais garantidoras ou do banco liquidante envolvidos na liquidação dos referidos eventos.

A utilização de modelos para estimar preços de determinados ativos e/ou estimar o comportamento futuro destes ativos, expõe o FUNDO a riscos de imprecisão ou mesmo de diferenças entre preços conforme os prestadores de serviço de controladoria, o que pode resultar em preços diferentes para um mesmo ativo em distintas carteiras no mercado.

CONCENTRAÇÃO

Em função da estratégia de gestão o FUNDO pode se sujeitar ao risco de perdas por não-diversificação de emissores, classes de ativos, mercados, modalidades de operação, ou setores econômicos.

LIQUIDEZ

Dependendo das condições do mercado, os ativos financeiros do FUNDO podem sofrer diminuição de possibilidade de negociação. Nesses casos, o GESTOR poderá, eventualmente, ver-se obrigado a aceitar descontos ou deságios na venda dos ativos (ou de ágio na compra), prejudicando a rentabilidade do fundo.

Por prever a alocação de recursos em instrumentos com potencial de retorno superior ao de instrumentos tradicionais, porém com potencial de negociabilidade no mercado mais restrita que os instrumentos convencionais, o FUNDO poderá ter que aceitar deságios em relação ao preço esperado de seus instrumentos e com isso impactar negativamente a sua rentabilidade.

Apesar do esforço e diligência do Gestor e Administrador em manter a liquidez da carteira do fundo adequada ao prazo de pagamento de resgates, existe o risco de descasamento entre a efetiva liquidez e o prazo para pagamento dos resgates. Isso pode acontecer em função de momentos atípicos de mercado ou por falha em modelo de estimativa de liquidez que se baseia em dados estatísticos e observações de mercado.

CRÉDITO

As operações do FUNDO estão sujeitas à inadimplência ou mora dos emissores dos seus ativos financeiros e contrapartes, inclusive centrais garantidoras e prestadores de serviços envolvidos no trânsito de recursos do FUNDO, caso em que o FUNDO poderá (i) ter reduzida a sua rentabilidade, (ii) sofrer perdas financeiras até o limite das operações contratadas e não liquidadas e/ou (iii) ter desvalorização de parte ou todo o valor alocado nos ativos financeiros.

2. MONITORAMENTO DE RISCOS

São utilizadas no FUNDO técnicas de monitoramento de risco ("monitoramento") para obter estimativa do seu nível de exposição aos riscos acima mencionados, de forma a adequar os investimentos do FUNDO a seus objetivos.

2.1. Os níveis de exposição a risco (i) são definidos em comitês que contam com a participação dos principais executivos das áreas ligadas à gestão de recursos; (ii) são aferidos por área de monitoramento de risco especializada e segregada da mesa de operações; e (iii) podem ser obtidos por meio de uma ou mais das seguintes ferramentas matemático-estatísticas, dependendo dos mercados em que o FUNDO atuar:

(a) monitoramento de alavancagem – alavancagem é a utilização de operações que expõem o FUNDO a mercados de risco em percentual superior ao seu patrimônio, com o consequente aumento dos riscos e da possibilidade de perdas;

(b) VaR – Valor em Risco – estimativa da perda potencial para a carteira do FUNDO, em dado horizonte de tempo, associado a uma probabilidade ou nível de confiança estatístico;

(c) teste de estresse – medida de risco para avaliar o comportamento da carteira do FUNDO em condições significativamente adversas de mercado, baseada em cenários passados, projetados de forma qualitativa ou ainda por métodos quantitativos;

(d) tracking risk – estimativa para medir o risco de o FUNDO não seguir a performance de seu objetivo de investimento.

(e) monitoramento de liquidez – apuração do valor total dos ativos passíveis de liquidação financeira em um determinado prazo, ponderado pelas regras de resgate e pela composição da carteira do FUNDO, atribuindo-se probabilidades para a negociação desses ativos nas condições de mercado vigentes.

2.2. O monitoramento (i) leva em conta as operações do FUNDO; (ii) utiliza dados históricos e suposições para tentar prever o comportamento da economia e, consequentemente, os possíveis cenários que eventualmente afetem o FUNDO, não há nenhuma garantia de precisão desses cenários; e (iii) não elimina a possibilidade de perdas.

2.3. As simulações e estimativas utilizadas no monitoramento dependem de fontes externas de informação, motivo pelo qual o ADMINISTRADOR isenta-se de responsabilidade se tais fontes fornecerem dados incorretos, incompletos ou suspenderem a divulgação dos dados, prejudicando o monitoramento.



3. APURAÇÃO DO VALOR DOS ATIVOS FINANCEIROS DO FUNDO

A apuração do valor dos ativos financeiros do FUNDO, para efeito de cálculo do valor da cota utilizada nas aplicações e resgates no FUNDO, será feita diariamente pelo ADMINISTRADOR, ou terceiros por ele contratados, de acordo com o manual de precificação do Controlador, preferencialmente com base em fontes públicas do mercado e consolidará tais valores, obtendo, assim, o valor global do patrimônio do FUNDO e, consequentemente, o valor da cota do FUNDO a ser utilizado para aplicações e resgates.

4. APLICAÇÕES E RESGATES EM DIAS SEM EXPEDIENTE BANCÁRIO

As aplicações e os resgates solicitados nos dias sem expediente bancário nacional serão processados no dia subsequente em que houver expediente bancário, como se nesse dia tivessem sido solicitados. Todavia, nas localidades em que os bancos funcionarem, as aplicações e resgates serão processados normalmente.

5. ENCARGOS

Além da taxa de administração e de performance, quando aplicável, são encargos do FUNDO: (i) tributos que recaiam ou venham a recair sobre os bens, direitos e obrigações do FUNDO; (ii) registro de documentos em cartório, impressão, expedição e publicação de relatórios e informações periódicas; (iii) correspondências, inclusive aos cotistas; (iv) despesas com auditor independente; (v) emolumentos e comissões pagas por operações do FUNDO; (vi) honorários advocatícios, custas e despesas processuais incorridas na defesa dos interesses do FUNDO, em juízo ou fora dele, inclusive o valor de eventual condenação; (vii) prejuízos não cobertos por seguros e não decorrentes diretamente de culpa ou dolo dos prestadores de serviços, no exercício de suas respectivas funções; (viii) despesas relacionadas, direta ou indiretamente, ao exercício do direito de voto, decorrentes de ativos financeiros do FUNDO; (ix) despesas com custódia (caso esta não esteja incluída na taxa de administração do FUNDO), liquidação e registro de operações com ativos financeiros e modalidades operacionais integrantes ou que venham a integrar a carteira do FUNDO; (x) despesas relacionadas com fechamento de câmbio, vinculadas às suas operações ou com certificados ou recibos de depósito de ativos financeiros; (xi) montantes devidos aos fundos investidores em decorrência de acordos de remuneração, que serão deduzidos da taxa de administração e performance, quando aplicável.

6. POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO DE RESULTADOS

Os resultados do FUNDO serão automaticamente nele reinvestidos.

7. ASSEMBLEIA GERAL

Os cotistas serão convocados, pelo ADMINISTRADOR para tratar de assuntos do FUNDO (i) anualmente, até 120 (cento e vinte) dias após o encerramento do exercício social, para deliberação sobre as demonstrações contábeis ou (ii) extraordinariamente, sempre que necessário.

7.1. As assembleias gerais obedecerão as seguintes regras: (i) serão convocadas conforme o(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste Regulamento, com antecedência mínima de 10 (dez) dias, dispensada esta formalidade se houver presença total; (ii) serão instaladas com qualquer número de cotistas; (iii) as deliberações serão tomadas por maioria de votos, cabendo 1 (um) voto para cada cota; (iv) podem votar os cotistas, seus representantes legais ou procuradores constituídos há menos de 1 (um) ano; (v) os cotistas poderão enviar seu voto por meio de comunicação física ou eletrônica, desde que a convocação indique essa possibilidade e estabeleça os critérios para essa forma de voto, que não exclui a realização da reunião de cotistas, no local e horário estabelecidos, cujas deliberações serão tomadas pelos votos dos presentes e dos recebidos pelo(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste Regulamento, quando assim admitido na convocação; (vi) a critério do ADMINISTRADOR, que definirá os procedimentos a serem seguidos, as deliberações da assembleia serão tomadas por meio de consulta formal, sem reunião de cotistas, em que a) os cotistas manifestarão seus votos, conforme instruções previstas na convocação e b) as decisões serão tomadas com base na maioria dos votos recebidos.

7.1.1. Na hipótese prevista no inciso (v) acima, no caso de não comparecimento físico de cotistas, a assembleia será instalada, sendo a presença dos cotistas caracterizada pelos votos encaminhados antes da realização da assembleia.

7.1.2. Caso a convocação preveja a realização da assembleia por meio eletrônico, os votos dos cotistas relativamente às suas deliberações em assembleia geral deverão ser proferidos mediante a utilização de assinatura eletrônica legalmente reconhecida, sob pena de recusa pelo ADMINISTRADOR.

7.1.3. Na hipótese da não instalação da assembleia geral para deliberação relativa às demonstrações contábeis do FUNDO, em decorrência do não comparecimento de quaisquer cotistas, serão consideradas automaticamente aprovadas caso as demonstrações contábeis não contenham quaisquer ressalvas.

7.2. O ADMINISTRADOR disponibilizará resumo das deliberações da assembleia geral aos cotistas, em até 30 (trinta) dias após a realização da assembleia, conforme o(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste Regulamento, o qual também.



8. ATOS E FATOS RELEVANTES

Os atos ou fatos relevantes que possam influenciar, direta ou indiretamente, as decisões de investimento no FUNDO serão imediatamente divulgados aos cotistas por correspondência eletrônica ou outra forma de comunicação disponibilizada pelo ADMINISTRADOR, conforme cláusula específica do regulamento.

9. MEIOS DE COMUNICAÇÃO

O FUNDO utilizará meios eletrônicos de comunicação relativamente às suas informações, inclusive no que diz respeito às convocações, deliberações e resumo das assembleias gerais. Nesse sentido, todas as informações ou documentos serão disponibilizados aos cotistas, pelo ADMINISTRADOR, no endereço eletrônico do ADMINISTRADOR disponível no Formulário de Informações Complementares do FUNDO, sem prejuízo da possibilidade de o ADMINISTRADOR adotar outra forma de disponibilização, a seu critério, nos termos da regulamentação. Excepcionalmente e não obstante o disposto na regulamentação em vigor, o FUNDO poderá, ainda, utilizar meios físicos de comunicação relativamente à divulgação de suas informações. Na hipótese de envio, pelo ADMINISTRADOR, de correspondência física para o endereço de cadastro do cotista, os custos decorrentes deste envio serão suportados pelo FUNDO.

10. FORO

Fica eleito o Foro do domicílio ou da sede do cotista, salvo se o domicílio ou sede do cotista não se situar em território brasileiro, caso em que fica eleito o foro da sede da Capital do Estado de São Paulo.

Para mais informações sobre o FUNDO, consulte o Formulário de Informações Complementares e a Lâmina.

São Paulo - SP, 20 de outubro de 2015.

Dúvidas, reclamações e sugestões, fale com o seu Gerente ou com a Área de Atendimento (11) 5029-4837 / 1579 / 1682. Se necessário, utilize o SAC Itaú 0800 728 0728, todos os dias, 24h, ou o Fale Conosco (www.itaubank.com.br). Se desejar a reavaliação da solução apresentada após utilizar esses canais, recorra à Ouvidoria Corporativa Itaú Unibanco 0800 570 0011, dias úteis, das 9 às 18h, Caixa Postal nº 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala 0800 722 1722, disponível 24h todos os dias.

ANEXO I – DESCRIÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS



LIMITES POR ATIVO (% do patrimônio do FUNDO)			
Legislação	Fundo	Descrição dos Ativos Financeiros	
GRUPO I – No mínimo 95%	Até 100%	Permitido	Cotas de fundos de investimento classificados como "Renda Fixa".
	Até 20%	Permitido	FIDC e FICFIDC
		Vedado	FII
	Até 10%	Vedado	Ativos Financeiros no Exterior compatíveis com a política do FUNDO: o FUNDO poderá aplicar em cotas de fundos de investimento constituídos no exterior, bem como os fundos de investimento nos quais o FUNDO aplica seus recursos poderão aplicar em cotas de fundos de investimento, ativos financeiros e modalidades operacionais emitidos, negociados ou constituídos no exterior e que atendam, alternativamente, aos seguintes requisitos: (i) sejam admitidos à negociação em bolsa de valores, de mercadorias e futuros ou registrados em sistemas de registro, custódia ou de liquidação financeira devidamente autorizados em seus países de origem e supervisionados por autoridade local reconhecida, nos termos da regulamentação em vigor; ou (ii) tenham a existência no exterior assegurada pelo CUSTODIANTE mediante procedimento específico previsto na regulamentação em vigor.
GRUPO II – Até 5%		Permitido	Títulos públicos federais.
		Permitido	Títulos de renda fixa de emissão de instituições financeiras.
		Permitido	Operações compromissadas.

LIMITES POR EMISSOR (% do patrimônio do FUNDO)		
Legislação	Fundo	Emissor
Até 100%	Permitido	Fundo de investimento
Até 5%	Permitido	Instituição financeira autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil
	Vedado	Companhia aberta
	Vedado	Pessoa física ou jurídica de direito privado que não seja companhia aberta ou instituição financeira autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil

LIMITE PARA CRÉDITO PRIVADO (% do patrimônio do FUNDO)	
Até 50%	Ativos financeiros de responsabilidade de pessoas físicas ou jurídicas de direito privado ou de emissores públicos que não a União Federal, direta ou indiretamente.

DERIVATIVOS	
Hedge e posicionamento	Limitado a uma vez o patrimônio
Este FUNDO poderá aplicar em fundos de investimento que utilizam estratégias com derivativos como parte integrante de suas respectivas políticas de investimento.	

OPERAÇÕES COM O ADMINISTRADOR, GESTOR E LIGADAS (% do patrimônio do FUNDO)	
Até 100%	Contraparte ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas, inclusive veículos de investimento por eles administrados ou geridos.
Até 5%	Ativos Financeiros de renda fixa emitidos pelo ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas.
Até 100%	Cotas de fundos de investimento administrados pelo ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas.

Consulta Pública de Lâmina de Fundo



Atenção: Estas informações tem por base os documentos enviados à CVM pelas Instituições Administradoras dos Fundos de Investimento e são de exclusiva responsabilidade destas. Sua divulgação pela CVM não implica na garantia da veracidade das informações prestadas ou do julgamento sobre a qualidade do fundo.

Competência:	Nov/2019 ▼	Exibir
Nome do Fundo:	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CNPJ: 05.073.656/0001-58
Tipo:	FDOS DE INVESTIMENTO	Cód. CVM: 19186
Administrador:	ITAÚ UNIBANCO S.A.	CNPJ: 60.701.190/0001-04

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O ITAÚ RENDA FIXA IMA-B
ATIVO FICFI**

Informações referentes a 11/2019

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, administrado por ITAU UNIBANCO S.A. e gerido por ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO. As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Regulamento do fundo, disponíveis no WWW.ITAÚ.COM.BR. As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada.

Antes de investir, compare o fundo com outros da mesma classificação.

1. PÚBLICO-ALVO: O Fundo, a critério do Administrador, receberá recursos de fundos de investimento, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento, pessoas físicas e/ou jurídicas, clientes do Administrador, do Gestor ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

Restrições de Investimento: NÃO HÁ RESTRIÇÃO.

2. OBJETIVOS DO FUNDO: Obter retorno superior a variação do IMA-B.

3. POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:

- a. O objetivo do FUNDO é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como "Renda Fixa", os quais apliquem, no mínimo, 80% 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 IMA-B, divulgada pela ANBIMA, observado que a rentabilidade do FUNDO será impactada pelos custos e despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.

b. O fundo pode:

Aplicar em ativos no exterior até o limite de	0%
Aplicar em crédito privado até o limite de	50%
Aplicar em um só fundo até o limite de	100%
Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira?	N
Alavancar-se até o limite de	35%

- Item b com redação dada pela Instrução CVM nº 563, de 18 de maio de 2015.

c. A metodologia utilizada para o cálculo do limite de alavancagem, disposto no item 3.b é o percentual máximo que pode ser depositado pelo fundo em margem de garantia para garantir a liquidação das operações contratadas somado à margem potencial para a liquidação dos derivativos negociados no mercado de balcão. Este fundo de investimento em cotas de fundos de investimento não realiza depósito de margem de garantia junto às centrais depositárias, mas pode investir em fundos de investimento que podem estar expostos aos riscos decorrentes de aplicações em ativos que incorram em depósito de margem de garantia. As informações apresentadas são provenientes dos fundos investidos geridos por instituições ligadas.

d. As estratégias de investimento do fundo podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

4. CONDIÇÕES DE INVESTIMENTO

Investimento inicial mínimo	R\$ 100.000,00
Investimento adicional mínimo	R\$ 0,00
Resgate mínimo	R\$ 0,00
Horário para aplicação e resgate	15:00
Valor mínimo para permanência	R\$ 1.000,00
Prazo de carência	Não há.
Condições de carência	Não há
Conversão das cotas	Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do 0º dia contado da data da aplicação. No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do 0º dia contado da data do pedido de resgate.
Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é de 1 dia(s) útil(is) contados da data do pedido

Taxa de administração	0,5% Comentários/Esclarecimentos por parte do fundo: 0,5% do patrimônio líquido ao ano.
Taxa de entrada	Não há taxa fixada. Outras condições de entrada: Não há.
Taxa de saída	Para resgatar suas cotas do fundo o investidor paga uma taxa de 0% do valor do resgate, que é deduzida diretamente do valor a ser recebido. Outras condições de saída: Não há.
Taxa de desempenho/performance	Não há.
Taxa total de despesas	As despesas pagas pelo fundo representaram 0,56% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/11/2018 a 31/10/2019 . A taxa de despesas pode variar de período para período e reduz a rentabilidade do fundo. O quadro com a descrição das despesas do fundo pode ser encontrado em WWW.ITAU.COM.BR .



5. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:[i]

O patrimônio líquido do fundo é de R\$ 297.221.816,97 e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são [ii] [iii]:

Títulos públicos federais	86,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	8,06%
Títulos de crédito privado	6,3%
Outras aplicações	1,79%
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	0,26%

6. **RISCO:** o Administrador ITAU UNIBANCO S.A. classifica os fundos que administra numa escala de 1 a 5 de acordo com o risco envolvido na estratégia de investimento de cada um deles. Nessa escala, a classificação do fundo é: 3

Menor Risco				Maior Risco	
1	2	3	4	5	

7. **HISTÓRICO DE RENTABILIDADE [iv] (para fundos não estruturados [v]) / SIMULAÇÃO DE DESEMPENHO (fundos estruturados [v])**

a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: 104,67%. No mesmo período o índice de referência [IMA-B] variou 104,9%.**

A tabela abaixo mostra a rentabilidade do fundo a cada ano nos últimos 5 anos.



Tabela de Rentabilidade Anual

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do índice de referência [IMA-B]	Desempenho do fundo como % do índice de referência [IMA-B]
2019	21,98%	20,53%	107,04%
2018	12,65%	13,06%	96,89%
2017	12,25%	12,79%	95,74%
2016	24,52%	24,81%	98,82%
2015	8,62%	8,88%	97,06%

C. Rentabilidade Mensal : a rentabilidade do fundo nos últimos 12 meses foi: [vi]

Mês [vii]	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do índice de referência [IMA-B]	Desempenho do fundo como % do índice de referência [IMA-B]
11	-2,78%	-2,45%	113,37%
10	3,61%	3,36%	107,38%
9	3,13%	2,86%	109,42%
8	-0,43%	-0,4%	107,63%
7	1,45%	1,29%	112,69%
6	4,26%	3,73%	114,18%
5	3,99%	3,66%	108,85%
4	1,67%	1,51%	110,91%
3	0,44%	0,58%	76,01%
2	0,52%	0,55%	95,87%
1	4,44%	4,37%	101,77%
12	1,73%	1,65%	105,18%

8. EXEMPLO COMPARATIVO:[viii] utilize a informação do exemplo abaixo para comparar os custos e os benefícios de investir no fundo com os de investir em outros fundos.

- a. **Rentabilidade: Se você tivesse aplicado R\$ 1.000,00 (mil reais) no fundo no primeiro dia útil de 2018 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano, no primeiro dia útil de 2019 , você poderia resgatar R\$ 1.205,23, já deduzidos impostos no valor de R\$ 43,53.**

A taxa de ingresso teria custado R\$ 0,00.



- b. **Despesas:** As despesas do fundo, incluindo a taxa de administração, a taxa de performance e as despesas operacionais e de serviços teriam custado R\$ 6,87.

9. **SIMULAÇÃO DE DESPESAS:**[ix] utilize a informação a seguir para comparar o efeito das despesas em períodos mais longos de investimento entre diversos fundos:

Assumindo que a última taxa total de despesas divulgada se mantenha constante e que o fundo tenha rentabilidade bruta hipotética de 10% ao ano nos próximos 3 e 5 anos, o retorno após as despesas terem sido descontadas, considerando a mesma aplicação inicial de R\$ 1.000,00 (mil reais), é apresentado na tabela abaixo:

Simulação das Despesas	[+3 anos]	[+5 anos]
Saldo bruto acumulado (hipotético - rentabilidade bruta anual de 10%)	R\$ 1.331,00	R\$ 1.610,51
Despesas previstas (se a TAXA TOTAL DE DESPESAS se mantiver constante)	R\$ 16,59	R\$ 27,80
Retorno bruto hipotético após dedução das despesas e do valor do investimento original (antes da incidência de impostos, de taxas de ingresso e/ou saída, ou de taxa de performance)	R\$ 314,41	R\$ 582,71

Este exemplo tem a finalidade de facilitar a comparação do efeito das despesas no longo prazo. Esta simulação pode ser encontrada na lâmina e na demonstração de desempenho de outros fundos de investimento.

A simulação acima não implica promessa de que os valores reais ou esperados das despesas ou dos retornos serão iguais aos aqui apresentados.

10. POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO:

- a. Descrição da forma de remuneração dos distribuidores:

Os distribuidores são contratados pelos próprios fundos, representados por seu administrador, para que suas cotas sejam ofertadas a potenciais investidores compreendidos no público alvo do fundo. Os distribuidores são remunerados a partir de uma parcela da taxa de administração do fundo, a qual remunera os prestadores de serviços, de modo geral. Na estrutura de "fund of funds", conforme público alvo do fundo alocador e manifestação de ciência do cotista, o gestor do fundo alocador também poderá ser remunerado pela distribuição dos fundos.

- b. O principal distribuidor oferta, para o público alvo do fundo, preponderantemente fundos geridos por um único gestor, ou por gestores ligados a um mesmo grupo econômico?

O Itaú Unibanco, principal distribuidor em seu conglomerado, adota como política ofertar a seus clientes, pessoas naturais e jurídicas, preponderantemente, cotas de fundos administrados ou geridos pelo próprio Itaú Unibanco ou por sociedades de seu conglomerado.

c. Há informações que indiquem a existência de conflitos de interesses no esforço de venda?

O Itaú Unibanco distribui preponderante fundos de gestão própria ou ligadas. Exceto por isto, não se identifica conflito e, por consequência, procedimentos para mitigá-los, salvo pela manutenção de grades de fundos segregadas por segmentos de clientes. O Itaú Unibanco distribui preponderante fundos de gestão própria ou ligadas.



11. SERVIÇO DE ATENDIMENTO AO COTISTA:

- a. Telefone 08007280728
- b. Página na rede mundial de computadores WWW.ITAUCOM.BR
- c. Reclamações: www.itaubr.com.br

12. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO:

- a. Comissão de Valores Mobiliários - CVM
- b. Serviço de Atendimento ao Cidadão em <http://www.cvm.gov.br>.

[i] Item dispensado nas lâminas apresentadas para registro do fundo, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[ii] Quando se tratar de fundo de investimento em cotas - FIC, a informação deve ser dada em relação à carteira dos fundos investidos.

[iii] Para efeito de preenchimento, as espécies de ativos são: Espécie de ativo	Descrição
Títulos públicos federais	LTN; LFT; todas as séries de NTN
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	Operações de compra ou venda de ativos pelo fundo com garantia de recompra ou revenda pelo vendedor
Operações compromissadas lastreadas em títulos privados	Operações de compra ou venda de ativos pelo fundo com garantia de recompra ou revenda pelo vendedor
Ações	Ações e certificados de depósito de ações de companhias abertas
Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	CDB, RDB, LF, DPGE, CCCB, LCA, LCI
Cotas de fundos de investimento 409	Cotas de fundos de investimento regulados pela Inst. CVM nº 409, de 2004



investimento	outras instruções da CVM.
Títulos de crédito privado	Debêntures, notas promissórias, commercial paper, export note , CCB, CPR, WA, NCA, CDA e CDCA
Derivativos	Swaps , opções, operações a termo e operações no mercado futuro
Investimento no exterior	Ativos financeiros adquiridos no exterior
Outras aplicações	Qualquer aplicação que não possa ser classificada nas opções anteriores

[iv] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[v] Os fundos estruturados são definidos no OFÍCIO-CIRCULAR/CVM/SIN/Nº01/2010, de 8 de janeiro de 2010.

[vi] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[vii] Meses devem ser ajustados de acordo com a data de atualização da lâmina.

[viii] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[ix] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

Fale com a CVM



► Questionário Padrão
Due Diligence para Fundos de
Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

Itaú Asset Management

Questionário preenchido por:

Investment Communication

Data:

30 de Abril de 2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")



Sumário

Apresentação.....	3
1) Informações sobre o Fundo de Investimento.....	4
1 - Alterações desde a última atualização	4
2 - Informações Qualitativas.....	5
2.1 – Perfil.....	5
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo.....	6
2.3 - Estratégias e Carteiras.....	6
3 - Informações Adicionais.....	8
4 - Gestão de Risco	9
5 – Comportamento do Fundo em Crises.....	11
6 - Três períodos de maior perda do Fundo (<i>peak to valley</i>).....	11
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	11
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	12
9 – Atendimento aos Cotistas.....	12
10 - Investimento no Exterior.....	12
11 – Anexos	13
2) Declaração.....	14
3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento	15
Atualizar Sumário.....	

(Para atualizar o sumário, clique no texto acima com o botão direito, atualizar campo, atualizar apenas os números de página)



Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.



1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização	
1.1	Nome
Itaú Renda Fixa IMA-B Ativo FICFI	
1.2	CNPJ
05.073.656/0001-58	
1.3	Data de início
28/11/2002	
1.4	Classificação CVM
Renda Fixa	
1.5	Classificação ANBIMA
Renda Fixa – Duração Alta – Grau de Investimento	
1.6	Código ANBIMA
108006	
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?
Não.	
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)
Longo Prazo sem Compromisso	
1.9	Público-alvo
O fundo, a critério do administrador, receberá recursos de fundos de investimento, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento, pessoas físicas e/ou jurídicas, clientes do administrador, do gestor ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A. 2.1. 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 às 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 de seus recursos estabelecidos pela regulamentação que lhe seja aplicável a tais entidades.	
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?
Sim, o regulamento prevê adequação as seguintes resoluções: RPPS (3922), EFPC (3792) e CVM 555.	
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?
Não.	
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)
Conta isenta: 2001 83212-6/Conta tributada: 2001 83213-4	
1.13	Conta CETIP (nº)
00383.44-2	
1.14	Administração (indique contato para informações).
A Administração é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)	
1.15	Custódia (indique contato para informações).
A Custódia é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)	
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).
Pricewaterhousecoopers Auditores Independentes	
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:
Escriturador	Não se aplica
Agente de depósito (Custódia Física)	Não se aplica



Consultor Especializado	Não se aplica
Assessor Jurídico	Não se aplica
Seguradora	Não se aplica
1.18	Cotização: abertura ou fechamento? Fechamento
1.19	Regras para aplicação e resgate:
	Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)
	Aplicação: D+0 Liquidez: diária Horário para movimentações: 15:00
	Carência/Tempo mínimo para permanência (<i>lock-up period</i>) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.
	N/A
	Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)
	Fechamento às 15:00h; Conversão do resgate: D+0 (da solicitação) Pagamento do resgate: D+1 (da conversão).
	Aplicação inicial mínima
	R\$ 100.000,00
	Aplicação máxima por cotista
	N/A
	Aplicação adicional mínima
	R\$ 0,00
	Resgate Mínimo
	R\$ 0,00
1.20	Taxa de Entrada (<i>upfront fee</i>)
	Não.
1.21	Taxa de Saída (<i>redemption fee</i>)
	Não.
1.22	Taxa de Administração
	A taxa de administração, fixa e anual, é de 0,5% provisionada apropriada e paga por dia útil, mediante divisão da taxa anual por 252 dias.
1.23	Taxa de Administração máxima
	0,5% a.a.
1.24	Taxa de Performance
	• % N/A
	• <i>Benchmark</i> N/A
	• Frequência N/A
	• Linha-d'água N/A
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?
	O custo total estimado aproximado é 0,0199% do PL ao ano.
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?
	Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?
	Não.
2 - Informações Qualitativas	
2.1 – Perfil	
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de



	investimento.
O objetivo do fundo é 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.	
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.
Não houve alterações desde a abertura do fundo.	
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.
A área de Renda Fixa possui fóruns diários, semanais e mensais onde são implementadas as várias etapas do processo de investimento: geração de ideia, discussão de cenários, construção do portfólio e gestão de riscos. As reuniões são dinâmicas e interativas, onde todos os participantes são incentivados a contribuir independente de sua posição. Vale ressaltar que a equipe de Renda Fixa conta com um forte apoio da equipe econômica e quantitativa para desenvolver projeções das principais variáveis macroeconômicas, traçar cenários econômicos (base e alternativos) e identificar oportunidades de investimento. No processo de construção do portfólio, a equipe busca identificar estratégias que apresentam uma relação risco x retorno atraente, e o dimensionamento da posição é ajustado de acordo com o nível de convicção da equipe. Definimos também um preço "target" e "stop-loss" para cada uma destas posições ativas e, uma vez implementadas, são revisitadas frequentemente para verificar se os fundamentos que basearam o posicionamento continuam válidos ou não. Finalmente, no processo de gestão de risco, variáveis como o stress, VaR, liquidez, duration e demais parâmetros definidos pela política de investimento para cada um dos fundos são monitorados diariamente.	
2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.
Por favor vide texto acima.	
2.1.5	Cite as premiações, ratings e rankings.
A Itaú Asset Management foi premiada pela décima vez e a sexta consecutiva, como Melhor Gestora de Fundos do Ano pelo Guia EXAME de Investimentos 2018. E também foi escolhida, pela mesma publicação, Melhor Gestora de Fundos em Multimercado, além de Melhor Gestora de Fundos de Varejo Seletivo, Alta Renda e Atacado. A Itaú Asset Management não possui ratings por fundo.	
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo	
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).
A equipe de Renda Fixa é formada por 6 profissionais. A equipe tem 16 anos de experiência no mercado e em média 11 anos de experiência na Itaú Asset Management.	
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
N/A	
2.3 - Estratégias e Carteiras	
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
	▪ Brasil (exclusivamente) Sim
	▪ Brasil (predominantemente) especifique Não
	▪ Global especifique Não
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: stop loss, stop gain, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).



A Superintendência de Gestão de Risco Asset é responsável pelas definições de risco para cada papel e portfólio. No caso dos portfólios, o primeiro passo é definir os limites de risco para cada carteira, que será proposto e sujeito à aprovação no Comitê de Produtos.

A definição de cada limite de risco é baseada em diretrizes de investimento, simulações para cada medida como Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR), Stress Test e outras restrições específicas de acordo com cada cliente e segmento.

O controle de risco é formalizado em um mandato do fundo para uso interno e há controles em diferentes níveis (incluindo no nível do ativo).

Seguem abaixo as principais medidas de risco que usamos para monitorar e controlar os portfólios dos nossos clientes:

Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR) e Tracking Error Ex-ante:

- Modelo: Paramétrico (Métricas de Risco) e Não Paramétrico (Simulação de Monte Carlo para opções);
- Volatilidade e Correlação: EWMA - Exponentially Weighted Moving Average (= 0.94);
- Intervalo de confiança: 95% ou 99% e Holding Period: 1, 21 e 252 dias úteis

Stress Test:

- Valuation completa para o pior cenário;
- Cenários: Crises históricas, Cenários Prospectivos.

Risco de Liquidez:

- Curva de liquidez.
- Curva de Passivo, que é definida como o conjunto de piores resgates ocorridos em diferentes períodos que vão de 1 dia até 252 dias úteis;
- Estresse da Curva de Passivo, a partir do fator do grau de concentração dos cotistas. Este fator utiliza o coeficiente HHI (Herfindahl-Hirschman Index);

Outras ferramentas de monitoramento, sob demanda ou para necessidade de análise:

- DV01 para juros: 1 basis point para cada yield;
- GAP Analysis per market: Graph exposure % NAV versus duration

Para mais informações sobre a gestão de riscos, por favor referir a seção 4 do questionário.

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?	
Vedado.		
2.3.5	Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:	
• Proteção de carteira ou de posição	Sim ☒	Não ☐
• Mudança de remuneração/indexador	Sim ☒	Não ☐
• Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)	Sim ☒	Não ☐
• Alavancagem	Sim ☐	Não ☒
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:	



Juros	Sim ☒ Não ☐
Câmbio	Sim ☐ Não ☒
Ações	Sim ☐ Não ☒
Commodities	Sim ☐ Não ☒
Em Bolsas:	
▪ Com garantia	Sim ☒ Não ☐
▪ Sem garantia	Sim ☐ Não ☒
Em balcão:	
▪ Com garantia	Sim ☒ Não ☐
▪ Sem garantia	Sim ☐ Não ☒
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	
2.3.6.1 de fundos de terceiros?	Sim ☐ Não ☒
2.3.6.2 de fundos do gestor?	Sim ☒ Não ☐
3 - Informações Adicionais	
3.1 PL atual	
PL atual FIC: R\$ 109.409.804,18 PL atual FI: R\$ 4.328.977.370,37 (Data base: abril 2019)	
3.2 PL médio em 12 meses	
PL médio FIC: R\$ 83.761.275,20 PL médio FI: R\$ 4.328.977.370,37 (Data base: abril 2019)	
3.3 PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa	
PL atual da Estratégia: R\$ 40.886,84 MM (Data base: Março 2019)	
3.4 Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?	
A capacidade da estratégia é definida e reavaliada de forma periódica em comitê interno. Considera-se a liquidez do mercado, o prazo para o resgate e a capacidade da gestão de obter uma performance diferenciada na geração de alpha.	
3.5 Número de cotistas	
A estratégia conta com 233 cotistas considerando a soma de: - Quantidade de cotistas diretos do FI, desconsiderando os fundos espelho - Quantidade de cotistas dos fundos espelho do FI (Data base: abril de 2019)	
3.6 Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?	
Informação indisponível, de qualquer forma, o valor é irrisório em relação ao PL total.	
3.7 Descreva as regras de concentração de passivo	
Não há regras específicas para concentração de passivo.	
3.8 Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas	
Percentual detido pelos cinco maiores cotistas: 71,85% Percentual detido pelos dez maiores cotistas: 82,29% (Data base: abril de 2019)	
3.9 Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?	
A administração do fundo passou do Banco Itaúcard S.A. para o Itaú Unibanco S.A. em novembro de 2014.	
3.10 Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?	



A Pricewaterhousecoopers Auditores Independentes realiza auditoria para este fundo desde Março de 2019.	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
Não é permitido crédito privado.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O fundo segue a política de liquidez do Itaú Asset, de forma que sua liquidez seja compatível com o prazo para pagamento dos pedidos de resgate. São usados os controles de Curva de Liquidez, Curva de Passivo e Curva de Passivo Estressada.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
O Fundo não opera derivativos sem garantia.	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
A precificação de ativos/derivativos segue o Manual de Precificação da WMS. As metodologias de precificação são definidas pela Diretoria Gestão Risco e Planejamento.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, <i>Tracking Error</i> e <i>Expected Shortfall</i>)?
BVaR: metodologia paramétrica. Utiliza-se EWMA com lambda de 0,94 para o cálculo das volatilidades e covariâncias.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
A utilização do limite de risco é calculada diariamente com base na posição de fechamento do Fundo. Há três níveis de alerta reportados: alerta 1 utilização entre 70% e 85%, alerta 2 utilização entre 85% e 100% e alerta 3 utilização acima do limite. Os alertas 1 e 2 são reportados pela área de Risco para a ciência da gestão via e-mail. No caso do alerta 3, adicionalmente ao e-mail, o apontamento é cadastrado no sistema de follow up de desenquadramentos. A gestão deve preencher no sistema a justificativa para o estouro do limite e apresentar um plano de ação para a sua adequação ao mandato. As informações são analisadas pela área de Risco, que concordando com os argumentos passará a acompanhar o prazo dado para a regularização do limite. A área de Risco tem a decisão final sobre a zeragem do Fundo caso julgue necessário.	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto <i>stress</i>)?
O limite é de 4% do PL.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
O orçamento de BVaR é global e não por classe de ativos.	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
O fundo nunca atingiu o limite.	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
O fundo nunca atingiu o limite.	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos (data base: 30/04/2019)
3 meses?	0,2903%
6 meses?	0,2034%
12 meses?	0,1387%
24 meses?	0,1024%
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
Não é permitido ao Fundo se alavancar.	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de <i>stress</i> ?



N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o <i>stress</i> médio do Fundo nos últimos
3 meses?	N/A
6 meses?	N/A
12 meses?	N/A
24 meses?	N/A
4.16	Comente o último <i>stop loss</i> relevante do Fundo.



N/A					
5 – Comportamento do Fundo em Crises					
	Período	Evento	Comportamento	Explicação	
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Ago/98	Crise da Rússia	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Out/98	Quebra do LTCM	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Jan/99	Desvalorização do Real	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Mar/00	Crise do Nasdaq	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Abr/01	Apagão	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Set/01	Ataques terroristas nos EUA	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Jun/02	Marcação a mercado	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	Fundo: Não Iniciado Bench: Outro Bench		
	Mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	Fundo: -1,97% Bench: Outro Bench		
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	Fundo: 0,98% Bench: Outro Bench		
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	Fundo: 9,6% Bench: Outro Bench		
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	Fundo: 4,7% Bench: Outro Bench		
6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)					
	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1.	23/01/2013 03/02/2014		Fundo: -14,23% Bench: -14,18%		139 Dias
2.	16/05/2017 18/05/2017		Fundo: -7,9% Bench: -7,7%		53 Dias
3.	23/06/2015 23/09/2015		Fundo: -7,89% Bench: -7,84%		39 Dias
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)					
7.1	Atribuição		Contribuição (%)		
	N/A		N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).				
Não houve mudança de estratégia desde o início do fundo.					
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?				
Não.					



8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.	
8.3	Com que frequência é possível realizar <i>conference calls</i> com o gestor dos fundos?
A frequência dos calls é definida sob demanda.	
9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
SAC Itaú e área de atendimento Asset - Email: atendimentoasset@itau-unibanco.com.br – horário comercial e pelo telefone (11) 3631-2555.	
10 - Investimento no Exterior	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, <i>prime broker</i> , entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	



11 – Anexos		
11.1	Regulamento	Sim ☐ Não ☐
11.2	Prospecto	Sim ☐ Não ☐
11.3	Última lâmina	Sim ☐ Não ☐
11.4	Último Informe de Perfil Mensal (Arquivo XML - Padrão CVM) da carteira	Sim ☐ Não ☐
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo (Arquivo XML - Padrão CVM)	Sim ☐ Não ☐
11.6	Relatórios de Gestão	Sim ☐ Não ☐



2) Declaração

Declaramos que este questionário foi preenchido, revisado e assinado por pessoas devidamente autorizadas a fazê-lo, respondendo esta instituição pela sua exatidão, veracidade e integridade da informação de todo o conteúdo prestado neste documento e de seus anexos.

Comprometemo-nos a manter todas as informações deste questionário devidamente atualizadas semestralmente, enviando nova versão do questionário aos distribuidores e alocadores nos meses de janeiro e julho, com data-base dezembro e junho, com exceção das informações contidas no item 3 – Eventos Importantes, as quais serão atualizadas e comunicadas imediatamente após a sua ocorrência.

Local: <i>São Paulo</i>	Data: <i>29/07/2019</i>
Nome: <i>Cleber Gobby</i>	
Cargo: <i>Gerente Poder Público</i>	

Assinatura: _____

Cleber Gobby
Gerente Poder Público



3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos



SGD nº 2019/24839/032425

PARECER DINVEST Nº 13/2019

CREDENCIAMENTO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

NOME DO FUNDO:	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FICFI
CNPJ nº	05.073.656/0001-58
OBJETIVO:	Credenciamento
PROCESSO Nº	2018/24830/002656

Análise da Documentação

A partir da análise dos documentos apresentados pelo gestor e consulta às instituições reguladoras a Diretoria de Investimentos do Igeprev-TO (DINVEST), conclui os seguintes pontos quanto ao Fundo de Investimento:

1- Prestadores de serviço:

1.1. Administrador

Nome: ITAÚ UNIBANCO S.A.

CNPJ: 60.701.190/0001-04

Status: Credenciado

Vigência: 09/06/2020

Nr. Processo: 2018/24830/002656

1.2. Gestor

Nome: ITAÚ UNIBANCO S.A.

CNPJ: 60.701.190/0001-04

Status: Credenciado

Vigência: 09/06/2020

Nr. Processo: 2018/24830/002656

1.3. Distribuidor: ITAÚ UNIBANCO S.A., exclusivamente através de sua rede de agências.

1.4. Custodiante: ITAÚ UNIBANCO S.A.

1.5. Auditor Independente: Deloitte Touche Tohmatsu

1.6. Segmento de Mercado: Fundo de Renda Fixa

2- Fundo consta da lista de fundos vedados? Não. Consulta em 02/12/2019.

3- Documentos analisados: QDD, Lâmina, Regulamento, Carteira CVM.

3.1. Data de abertura / idade do fundo: 28/11/2002 – 17 anos





3.2. Objetivo do fundo: O fundo é 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 fatos 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.

3.3. Público alvo: O fundo, a critério do administrador, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do administrador, do gestor ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

3.4. Tipo de condomínio: Aberto.

3.5. Quantidade de cotistas: 93

3.6. Benchmark: IMA-B

3.7. Política de investimento: O objetivo do FUNDO é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como "Renda Fixa", os quais apliquem, no mínimo, 80% 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 IMA-B, divulgada pela ANBIMA, observado que a rentabilidade do FUNDO será impactada pelos custos e despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.

3.8. Principais categorias de ativos e fundos:

Títulos públicos federais	86,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	8,06%
Títulos de crédito privado	6,3%
Outras aplicações	1,79%
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	0,26%

3.9. Patrimônio Líquido: R\$ 297.221.816,97 (11/12/2019 - Lâmina)

3.10. Aplicação mínima: R\$ 100.000,00





3.11. Pagamento do resgate: D+1 dias úteis contados da data do pedido de resgate.

3.12. Taxas:

Entrada/Saída: 0% **Administração:** 0,5% a.a. **Gestão:** Não Informado
Custódia: Não há. **Performance:** Não há.

4- Rentabilidade:

Não foi informado no QDD ou na lâmina da CVM as tabelas de rentabilidades dos anos anteriores.



Os Fundos IMA-B ou chamados de fundos de inflação, são fundos de renda fixa que podem ter rentabilidades formidáveis, mas tem um risco maior que os de renda fixa tradicionais. Uma vez que os preços dos títulos estão atrelados à inflação que pode





ter uma volatilidade considerável. Por isso, podem ter altíssimos retornos e rentabilidade negativa.

Quando avaliamos a rentabilidade do Fundo Itaú Renda Fixa IMA-B **Ativo Fundo de investimento** em cotas de fundos de investimentos, e comparamos com os fundos IMA-B da nossa carteira que são boas opções de aplicação, nesse momento destacamos fundo Itaú Renda Fixa IMA-B Ativo, pois nos últimos 12 o conseguiu uma rentabilidade superior aos demais fundos no período analisado e possui maior Sharpe, além de conseguir uma rentabilidade superior ao índice de referência IMA-B nos últimos 12 meses.

5- Conclusão da análise

Trata-se de credenciamento de fundo de investimento em atendimento ao que dispõe a Resolução CMN 3.922/10 e Resolução 519/11 do Ministério de Previdência Social.

Conforme observado no Questionário *Due Diligence* – QDD Anexo 1 apresentado pela gestora, bem como na Lâmina e Regulamento do fundo consultado na página da Comissão de Valores Mobiliários – CVM, o fundo possui bons resultados de rentabilidade/risco.

Acrescenta-se, ainda, que uma aplicação no fundo atende às indicações de cenários avaliados para final de 2019 e o exercício de 2020.

Isto posto, recomenda-se o envio dos autos ao Comitê de Investimentos para deliberação quanto deferimento do credenciamento do novo fundo.

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIÁRIA DO ESTADO DO TOCANTINS, em Palmas, 20 dias do mês de dezembro do ano de 2019.

(assinado eletronicamente)
JÚLIO CÉSAR MEDEIROS LIMA
Gerente de Controle e Análise de Risco

(assinado eletronicamente)
REYNALDO FERREIRA DE MELO
Diretor de Investimentos





SGD nº 2020/24839/002835

PROCESSO Nº: 2018/24830/002656
INTERESSADO: ITAÚ UNIBANCO S.A.
CNPJ nº: 60.701.190/0001-04
ASSUNTO: Credenciamento

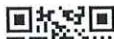
DESPACHO Nº 003/2020/DINVEST

Conforme as exigências da Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, que define normas complementares previstas na Resolução CMN nº 3.922, de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, para credenciamento de administrador, gestor, distribuidor e fundos de investimento, e ainda, conforme o Edital de Credenciamento nº 001/2019 de 25/10/2019, publicado no *site* do Instituto, a documentação analisada da Instituição atende às normas legais vigentes.

Encaminhem-se os autos ao Comitê de Investimentos para análise e deliberação.

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS, aos 03 dias do mês de fevereiro de 2020.

(assinado eletronicamente)
REYNALDO FERREIRA DE MELO
Diretor de Investimentos



Questionário ANBIMA de due diligence para contratação de Gestor de Recursos de Terceiros

Contratado:

Itaú Asset Management

Contratante:

Questionário preenchido por:

Time de vendas especializadas

Data:

31/10/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A").

Versão: [-]

Apresentação

Este questionário é baseado no Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros ("Código"). Ele tem o objetivo de auxiliar o administrador fiduciário no processo de contratação de gestores de recursos de terceiros para os fundos de investimento.

O questionário busca abordar, minimamente, a adoção de práticas consistentes, objetivas e passíveis de verificação que sejam suficientes não só para entender e mensurar os riscos associados à prestação de serviço como também para garantir um padrão aceitável da instituição a ser contratada.

O anexo ao questionário trata de informações específicas dos fundos de investimento.

O administrador fiduciário poderá adicionar outras questões julgadas relevantes na forma de anexo a esse questionário.

Este questionário deve ser respondido por profissional com poderes de representação, e qualquer alteração em relação às respostas enviadas e aos documentos encaminhados após o preenchimento deste questionário deve ser enviada à instituição que contratou a prestação de serviço em até cinco dias úteis da referida alteração.

Este questionário entrará em vigor em 11 de janeiro de 2019.

Sumário

Apresentação.....	1
1. Alterações desde a última atualização.....	4
2. Perfil	6
3. Equipe de gestão do fundo.....	7
4. Estratégias e carteiras.....	8
5. Uso de derivativos	9
6. Compra de cotas de fundos de investimento	9
7. Informações adicionais	9
8. Gestão de risco	10
9. Comportamento do fundo em crises	12
10. Três períodos de maior perda do fundo	13
11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos	13
12. Relacionamento com distribuidores/alocadores	13
13. Atendimento aos cotistas.....	14
14. Investimento no exterior.....	14
15. Anexos (quando aplicável)	15

ANEXO I – FUNDOS DE INVESTIMENTO

1. Alterações desde a última atualização

1.1 Nome do fundo

ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

1.2 CNPJ

16.718.302/0001-30

1.3 Data de início

31/10/2012

1.4 Classificação ANBIMA

Ações Livre

1.5 Código ANBIMA

318231

1.6 O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?

Não.

1.7 Classificação tributária (CP/LP/Ações)

Renda Variável

1.8 Descreva o público-alvo.

O fundo, a critério do administrador, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do administrador, do gestor ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

1.9 O regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução do CMN?

Sim, o regulamento prevê adequação à CVM 555.

1.10 Conta corrente (banco, agência, nº)

Conta Isenta: 8541 08890-5

Conta Tributada: 8541 08889-7

1.11 Conta CETIP (nº)

17116.44-4

1.12 Administração (indique contato para informações).

A Administração é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)

1.13 Custódia (indique contato para informações).

A Custódia é realizada pelo Itaú Unibanco S. A. (CNPJ: 60.701.190/0001-04)

1.14 Auditoria externa

Ernst & Young Auditores

1.15 Caso se aplique, informar:

Escriturador	Não se aplica.
Custodiante	Não se aplica.
Consultor Especializado	Não se aplica.
Assessor Jurídico	Não se aplica.
Co-gestor	Não se aplica.
Distribuidor	Não se aplica.
Outros	Não se aplica.

1.16 Cotização: abertura ou fechamento?

Fechamento.

Regras para aplicação e resgate:	
1.17 Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	Aplicação: D+0 Liquidez: diária Horário para movimentações: 16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	N/A
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	Conversão do resgate: D+21 dias úteis (da solicitação) Pagamento do resgate: D+2 dia útil (da conversão).
Aplicação inicial mínima	R\$ 5.000,00
Aplicação máxima por cotista	N/A
Aplicação adicional mínima	R\$ 1,00
Resgate mínimo	R\$ 1,00

1.18 Taxa de Entrada (upfront fee)

Não.

1.19 Taxa de Saída (redemption fee)

Não.

1.20 Taxa de administração

A taxa de administração fixa e anual é de 2,5% (dois virgula cinco por cento) provisionada por dia útil, mediante divisão da taxa anual por 252 dias, apropriada e paga mensalmente.

1.21 Taxa de administração máxima

2,5% a.a.

1.22 Taxa de custódia máxima

N/A

Taxa de Performance

% (Percentual)

Benchmark

Frequência

20% a.a.

IBOVESPA FECHAMENTO

Calculada a partir da valorização dos ativos do fundo, provisionada por dia útil como despesa do fundo e apropriada no mês subsequente ao encerramento dos meses de jun/dez de cada ano ou proporcionalmente, desde que o período não seja inferior a 6 (seis) meses, na hipótese de resgate.

Sim.

Ativo - Variação do Patrimônio Líquido –
Calculada a partir da valorização dos ativos do fundo.

1.23

Linha-d'água (sim ou não)

Método de cálculo (ativo/passivo/ajuste)

1.24 Despesas do fundo pagas ao grupo econômico do administrador (e da gestora, se este for diferente) excluindo-se as taxas de Administração e de Performance.

O custo total estimado aproximado é 0,0065% do PL ao ano.
(Data base: setembro de 2019).

1.25 Há acordo de remuneração com cláusula de reversão de rebate para o fundo? (pagamento e/ou recebimento).

Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.

2. Perfil

2.1 Descreva o fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.

O objetivo do fundo é 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.

2.2 Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do fundo.

Não houve alterações desde a abertura do fundo.

2.3 Descreva o processo decisório de investimento deste fundo de investimento.

A abordagem fundamentalista predomina na construção do portfólio e possui horizonte de análise de dois a três anos. Após um filtro de liquidez sobre a totalidade das ações de companhias brasileiras listadas em bolsa, um filtro qualitativo será aplicado num universo de cerca de 150 ações (notas individuais atribuídas aos seguintes critérios: análise do setor que a companhia se insere, posicionamento, administração, governança corporativa, índices financeiros, análise do balanço e valuation). Cerca de 100 teses de investimento poderão surgir das maiores somatórias de notas, recebendo então uma análise mais detalhada do balanço e valuation, além de uma cobertura mais próxima com visitas às empresas e acompanhamento dos calls de resultados. O dimensionamento do portfólio em cerca de 20 ações vai resultar de alguns filtros finais, considerando as melhores avaliações (recebem maior peso) e liquidez. Até 10% do portfólio poderá buscar oportunidades com maturação esperada de curto prazo, em geral com cerca de cinco ações, a partir de critérios de escolha por análise top-down e event-driven (exemplo: eventos societários, nova regulamentação, etc.). O tamanho das posições vai depender da convicção da gestão num upside de curto prazo. A depender das oportunidades de mercado, essa parte do portfólio poderá estar zerada. 20% do portfólio é composto por ações correlacionadas ao Ibovespa (componente beta). Por fim, a posição em caixa é gerida com flexibilidade a partir da maturação dos investimentos, busca de novas oportunidades, aversão ou apetite numa análise macro. A equipe de gestão se reúne formalmente uma vez por semana para debater os investimentos da carteira, sugerindo alterações e discutindo novos casos. Não buscamos risco de mercado nas operações de renda fixa que integram o caixa.

2.4 Cite as premiações, ratings e rankings dos últimos 05 anos.

A Itaú Asset Management foi premiada pela décima vez e a sexta consecutiva, como Melhor Gestora de Fundos do Ano pelo Guia EXAME de Investimentos 2018. E também foi escolhida, pela mesma publicação, Melhor Gestora de Fundos em Multimercado, além de Melhor Gestora de Fundos de Varejo Seletivo, Alta Renda e Atacado. A Itaú Asset Management não possui ratings por fundo.

3. Equipe de gestão do fundo

3.1 Cite os profissionais envolvidos na gestão

A equipe de gestão é formada por 10 profissionais com média de 11 anos de experiência no mercado e em média 8 anos de experiência na Itaú Asset Management.

3.2 Cite o histórico de alterações significativas na equipe nos últimos 05 anos.

N/A

4. Estratégias e carteiras

4.1 Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o fundo, em cenários de stress.

A Superintendência de Gestão de Risco Asset é responsável pelas definições de risco para cada papel e portfólio. No caso dos portfólios, o primeiro passo é definir os limites de risco para cada carteira, que será proposto e sujeito à aprovação no Comitê de Produtos.

A definição de cada limite de risco é baseada em diretrizes de investimento, simulações para cada medida como Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR), Stress Test e outras restrições específicas de acordo com cada cliente e segmento.

O controle de risco é formalizado em um mandato do fundo para uso interno e há controles em diferentes níveis (incluindo no nível do ativo).

Seguem abaixo as principais medidas de risco que usamos para monitorar e controlar os portfólios dos nossos clientes:

Value at Risk (VaR), Benchmark Value at Risk (B-VaR) e Tracking Error Ex-ante:

- Modelo: Paramétrico (Métricas de Risco) e Não Paramétrico (Simulação de Monte Carlo para opções);
- Volatilidade e Correlação: EWMA - Exponentially Weighted Moving Average (= 0.94);
- Intervalo de confiança: 95% ou 99% e Holding Period: 1, 21 e 252 dias úteis

Stress Test:

- Valuation completa para o pior cenário;
- Cenários: Crises históricas, Cenários Prospectivos.

Risco de Liquidez:

- Curva de liquidez.
- Curva de Passivo, que é definida como o conjunto de piores resgates ocorridos em diferentes períodos que vão de 1 dia até 252 dias úteis;
- Estresse da Curva de Passivo, a partir do fator do grau de concentração dos cotistas. Este fator utiliza o coeficiente HHI (Herfindahl-Hirschman Index);

Outras ferramentas de monitoramento, sob demanda ou para necessidade de análise:

- DV01 para juros: 1 basis point para cada yield;
- GAP Analysis per market: Graph exposure % NAV versus duration

Para mais informações sobre a gestão de riscos, por favor referir a seção 8 do questionário.

4.2 O fundo pode realizar operações de day trade?

É vedado ao Fundo, direta ou indiretamente, realizar operações denominadas day trade.

5. Uso de derivativos

5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:		
	Proteção de carteira ou de posição	SIM (X)	NÃO ()
	Mudança de remuneração/indexador	SIM (X)	NÃO ()
	Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)	SIM ()	NÃO (X)
	Alavancagem	SIM ()	NÃO (X)
5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:		
	Juros	SIM ()	NÃO (X)
	Câmbio	SIM ()	NÃO (X)
	Ações	SIM (X)	NÃO ()
	Commodities	SIM ()	NÃO (X)
	Em Bolsas:		
	Com garantia	SIM (X)	NÃO ()
	Sem garantia	SIM ()	NÃO (X)
	Em Balcão		
	Com garantia	SIM ()	NÃO ()
	Sem garantia	SIM ()	NÃO ()

5.3 Qual a abordagem da gestora no investimento em ativos de crédito privado?
Operações com crédito privado não são permitidas.

6. Compra de cotas de fundos de investimento

6.1	De fundos de terceiros?	SIM ()	NÃO (X)
6.2	De fundos da gestora?	SIM (X)	NÃO ()

7. Informações adicionais

7.1 PL atual.

PL atual FI: R\$ 863.038.306,32
PL atual FIC: R\$ 658.258.250,48
(Data base: setembro de 2019)

7.2 PL médio em 12 (doze) meses.

PL médio FI: R\$ 824.698.603,45
PL médio FIC: R\$ 632.143.862,64
(Data base: setembro de 2019)

7.3 PL atual da mesma estratégia sob gestão da gestora.

O PL atual total da estratégia Unconstrained sob gestão da empresa é de R\$ 8.833,35 MM.
(Data base: setembro de 2019)

7.4 Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do fundo e de sua estratégia? Quais são os critérios de definição?

A capacidade da estratégia é definida e reavaliada de forma periódica em comitê interno. Considera-se a liquidez do mercado, o prazo para o resgate e a capacidade da gestão de obter uma performance diferenciada na geração de alpha.

7.5 Número de cotistas.

O fundo conta com 50.461 cotistas considerando a soma de:

- Quantidade de cotistas diretos do FI, desconsiderando os fundos espelho
- Quantidade de cotistas dos fundos espelho do FI

(Data base: setembro de 2019)

7.6 Qual percentual do passivo do fundo representa aplicações da gestora, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?

Informação indisponível.

7.7 Descreva as regras de concentração de passivo.

Não há regras específicas para concentração de passivo.

7.8 Percentuais detidos pelos dez maiores cotistas.

Percentual detido pelos dez maiores cotistas: 16,31%

(Data base: setembro de 2019)

7.9 Houve alguma mudança de prestadores de serviços de administração fiduciária e/ou de custódia nos últimos 05 anos da operação do fundo? Quando?

Não.

7.10 A última demonstração financeira foi emitida com obteve algum parecer modificado (com ressalva, com abstenção de opinião, ênfase, parecer adverso opinião) pelo auditor independente?

N/A

8. Gestão de risco

8.1 Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do fundo.

Não é permitido ao fundo alocar em crédito privado.

8.2 Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do fundo.

O fundo segue a política de liquidez do Itaú Asset, de forma que sua liquidez seja compatível com o prazo para pagamento dos pedidos de resgate. São usados os controles de Curva de Liquidez, Curva de Passivo e Curva de Passivo Estressada.

8.3 Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.

O Fundo não opera derivativos sem garantia.

8.4 Se houver na carteira do fundo, ativos/derivativos ilíquidos/exóticos, como a gestora realiza o acompanhamento?

A precificação de ativos/derivativos segue o Manual de Precificação da WMS. As metodologias de precificação são definidas pela Diretoria Gestão Risco e Planejamento.

8.5 Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, Tracking Error e Expected Shortfall)?

TE - Metodologia Paramétrica. Utiliza-se EWMA com λ de 0,94 para o cálculo das volatilidades e covariâncias.

8.6 Existem limites adicionais àqueles que constam no regulamento/regulação (por ex: concentração por setor, emissor, contraparte, tipo de risco)? Quais?

O fundo possui limite de Tracking Error em relação ao Ibovespa.

8.7 Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 8.5

A utilização do limite de risco é calculada diariamente com base na posição de fechamento do Fundo. Há três níveis de alerta reportados: alerta 1 utilização entre 70% e 85%, alerta 2 utilização entre 85% e 100% e alerta 3 utilização acima do limite.

Os alertas 1 e 2 são reportados pela área de Risco para a ciência da gestão via e-mail. No caso do alerta 3, adicionalmente ao e-mail, o apontamento é cadastrado no sistema de follow up de desenquadramentos. A gestão deve preencher no sistema a justificativa para o estouro do limite e apresentar um plano de ação para a sua adequação ao mandato. As informações são analisadas pela área de Risco, que concordando com os argumentos passará a acompanhar o prazo dado para a regularização do limite. A área de Risco tem a decisão final sobre a zeragem do Fundo caso julgue necessário.

8.8 Qual o limite da(s) metodologia(s) citada no item 8.5?

O limite é de 16% de Tracking Error.

8.9 De que forma é apurado o consumo dos limites dados pela(s) metodologia(s) citada(s) no item 8.5?

O orçamento de Tracking Error é global e não por classe de ativos.

8.10 Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 8.5 foi excedido, por qual motivo e qual o máximo atingido? Comente.

Nos últimos 24 meses, o limite de TE nunca foi excedido.

8.11 Qual o VaR/B-VaR/TE médio do Fundo nos últimos:
3 meses?

| 7,737%

6 meses?	6,818%
12 meses?	6,641%
24 meses?	6,188%

8.12 Qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo fundo e em qual(is) ativo(s) nos últimos 24 (vinte e quatro) meses?

Não há limites de exposição por estratégias. O percentual de alocação nos mercados é dinâmico e diretamente ligado a percepção dos gestores quanto ao risco retorno dos diversos ativos.

8.13 Qual o limite para perdas em cenário de stress? Como são definidos os cenários (ex. Utiliza o cenário elaborado pela B³ ou o próprio)?

O fundo não possui limite de Stress.

8.14 Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite de stress foi excedido e por quê?

N/A

Qual o stress médio do fundo nos últimos:

8.15 3 (três) meses?	N/A
6 (seis) meses?	N/A
12 (doze) meses?	N/A
24 (vinte e quatro) meses?	N/A

8.16 Comente o último stop loss relevante do fundo.

9. Comportamento do fundo em crises

Período*	Evento	Comportamento (variação do fundo)	Explicação
Mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Jul – Ago/07	Crise das hipotecas	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Out/08 – Mar/09	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Abril/11 – Set/11	Segunda crise da dívida na Europa	Fundo: Não Iniciado Bench: Não Iniciado	
Abril/15 – Ago/16	Crise política / recessão no Brasil	Fundo: -10,39% Bench: -17,08%	

* Para o período solicitado deve ser informado o comportamento (variação do fundo) de acordo com o mês fechado (ex. 01/01 a 31/01).

10. Três períodos de maior perda do fundo

	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para recuperação
1	02/09/2014 26/01/2016		Fundo: -27,78% Bench: -39,42%		114 Dias
2	01/02/2013 03/07/2013		Fundo: -15,53% Bench: -25,36%		239 Dias
3	27/04/2018 21/06/2018		Fundo: -14,48% Bench: -18,94%		76 Dias

11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos

11.1 Atribuição: | Contribuição:

11.2 Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).

Não houve mudanças.

11.3 O fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação da gestora, do administrador fiduciário ou órgão regulador? Quando? Por quê?

Sim. Por decisão do gestor.

12. Relacionamento com distribuidores/alocadores

12.1 Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?

Por favor consultar seu gerente de relacionamento.

12.2 Com que frequência é possível realizar conference calls com a gestora dos fundos?

Os calls podem ser agendados sob demanda com a equipe de Portfolio Specialist.

12.3 Por quais canais o fundo é distribuído?

Itaú Unibanco possui um canal próprio de distribuição.

12.4 Considerando o montante total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores distribuidores ou alocadores, individualmente?

Informação confidencial.

13. Atendimento aos cotistas

- 13.1 Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?

Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.

- 13.2 Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?

Para informações, favor entrar em contato com o gerente de relacionamento.

- 13.3 Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?

SAC Itaú e área de atendimento Asset - Email: atendimentoasset@itau-unibanco.com.br – horário comercial e pelo telefone (11) 3631-2555.

14. Investimento no exterior

- 14.1 Qual o produto (tipo de ativo ou fundo investido) e sua estrutura, incluindo os veículos utilizados (se houver)? Descreva a estratégia, os principais ativos e instrumentos utilizados.

N/A

- 14.2 Quais os riscos envolvidos?

N/A

- 14.3 Quais são os mercados em que o fundo opera?

N/A

- 14.4 Em relação ao veículo local, o fundo utiliza estratégias para proteção cambial?

N/A

Caso o fundo de investimento local tenha por objetivo o investimento em único fundo de investimento ou veículo no exterior (fundo espelho), enumerar os prestadores de serviços e demais informações dos fundo de investimento ou veículo no exterior (administrador, custodiante, RTA, prime broker, entre outros).

Administrador Fiduciário

Custodiante

Auditor

14.5

RTA

Prime Brokers

NAV Calculator

Domicílio do fundo

Taxa de administração

Código ISIN do fundo

Moeda do domicílio fundo no exterior

Outros prestadores de serviço, dos
investimentos no exterior, caso exista.

14.6 Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de
contaminação entre elas.

N/A

14.7 Caso a gestora tenha influência direta/indireta na gestão do fundo no exterior, descreva
como foi constituída a diretoria do fundo.

N/A

15. Anexos (quando aplicável)

15	Anexos (quando aplicável)	Marcar Anexos ou link para acesso ao documento
15.1	Regulamento	
15.2	Formulário de informações complementares	
15.3	Última lâmina de informações essenciais	
15.4	Relatório de Gestão e/ou materiais de divulgação	

[LOCAL, DATA]

[ASSINATURA DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO]	[ASSINATURA DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA INSTITUIÇÃO]
[NOME DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO]	[NOME DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA INSTITUIÇÃO]
[CARGO]	[CARGO]
[TELEFONE]	[TELEFONE]
[E-MAIL CORPORATIVO]	[E-MAIL CORPORATIVO]

janeiro-2020

data base: 31 de dezembro de 2019

Objetivos do Fundo

Estratégia de renda variável que realiza profunda análise investigativa para encontrar oportunidades em empresas que possuam qualidade e atratividade ainda não precificadas pelo mercado.

Análise de Retorno

35,46 %

Rentabilidade nominal dos últimos 12 meses

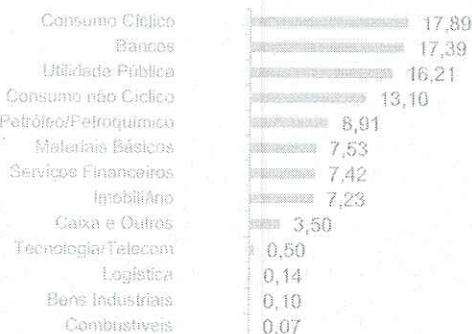
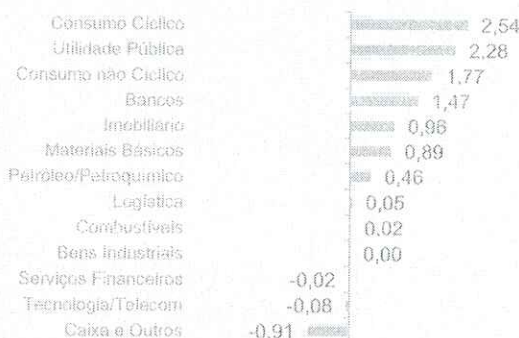
3,87 % + Benchmark

Rentabilidade relativa ao benchmark dos últimos 12 meses

75,52 % + Benchmark

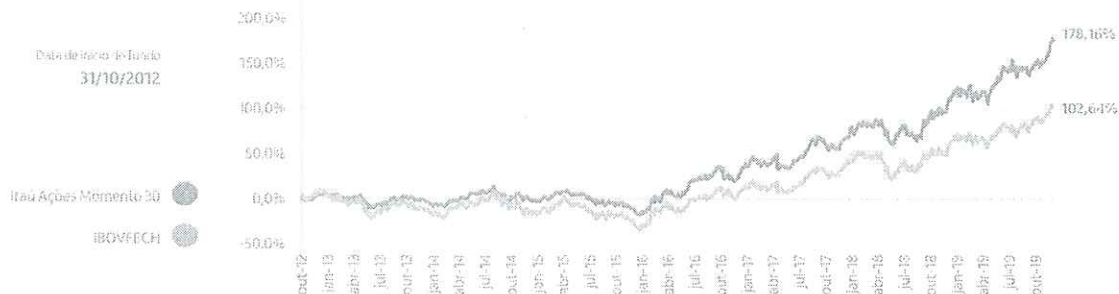
Rentabilidade relativa ao benchmark desde o início do fundo (31/10/2012)

Termômetro de Risco

Alocação média setorial no mês
% da carteiraContribuição Setorial no Mês
Retorno em %

Retorno acumulado

(Acumulado desde o início)



Retorno Mensal

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2019													
Fundo	8,48%	-1,51%	-0,70%	1,08%	2,05%	4,76%	3,84%	0,99%	0,34%	1,20%	1,37%	9,45%	35,46%
+/- Bench	-2,35%	0,35%	-0,52%	0,09%	1,35%	0,71%	3,00%	1,65%	-3,23%	-1,16%	0,43%	2,60%	3,87%
2018													
Fundo	8,46%	1,63%	1,36%	2,05%	-8,12%	-3,35%	6,83%	-3,64%	-0,32%	13,71%	2,84%	2,35%	24,35%
+/- Bench	-2,68%	1,11%	1,35%	1,17%	2,75%	1,85%	-2,04%	-0,43%	-3,79%	3,53%	0,46%	4,16%	9,32%
2017													
Fundo	10,11%	3,73%	-1,53%	1,43%	-4,34%	0,33%	5,73%	7,49%	4,67%	-0,58%	-3,54%	5,60%	31,91%
+/- Bench	2,73%	0,65%	0,99%	0,78%	-0,23%	0,03%	0,93%	0,03%	-0,21%	-0,60%	-0,39%	-0,56%	5,05%

Consultório do Gestor

86

Meses desde o início do fundo

62%

Meses em que esteve acima do benchmark

62%

Meses de retorno positivo do fundo

17,00% Volatilidade 12 Meses

Os mercados acionários apresentaram forte desempenho em dezembro. A melhora de avaliação do cenário de crescimento mundial, a evolução de um acordo comercial preliminar entre os Estados Unidos e a China, além da expectativa de que as principais economias seguirão com suporte monetário e/ou fiscal, impulsionaram os ativos de risco. O Ibovespa subiu 6,85% (31,58% em 2019) e o IBRX 7,27% (33,39% em 2019), com destaque no mês para o desempenho das ações dos setores imobiliário e de materiais básicos. Os fundamentos econômicos e os fatores técnicos sustentaram a alta do mercado nacional. Os principais motivos são: PIB em expansão e com possíveis surpresas positivas (viés para maiores receitas e alavancagem operacional); e cenário de juros baixos por um longo tempo (com rotação dos portfólios de renda fixa que gera fluxo doméstico). Na estratégia Momento, em termos absolutos, tivemos performance positiva, principalmente por nossas posições nos setores de consumo cíclico, de utilidade pública e consumo não cíclico. Em contrapartida, nossas alocações nos setores de tecnologia e de serviços financeiros detraíram o resultado no mês.

Características

Clique aqui para investir

Volume Global Mínimo*
R\$ 5.000,00

Classificação Tributária
Renda Variável

Patrimônio Líquido Médio nos últimos 12 meses
R\$ 677.346.033,14

Taxa de Administração
2,50% ao ano

Taxa de Performance
20% do que exceder 100% do
IBOVESPA FECHAMENTO.

Público Alvo
Público Em Geral

Horário para Movimentação
Até às 16:00

Aplicação e Resgate
Cota de aplicação: D+0
Cota de resgate (dias úteis): D+21
Crédito do resgate (dias úteis): D+23

Acesse outros documentos relevantes deste fundo: www.itaui.com.br/investimentos-previdencia/fundos/informacoes-cotistas/

Glossário: LF - Letra Financeira; CDB - Certificado de Depósito Bancário; LSF - Letra Financeira Subordinada; LFSN - Letra Financeira Elegível - Nível II; DEB - Debentures; NP - Notas Promissórias; CCB - Cédula de Crédito Bancário; FIDC - Fundo de Investimento em Direitos Creditórios; DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial; Debentures Conversível; Certificado de Recebíveis Imobiliários; LC - Letra de Crédito; LCA - Letra de Crédito Agrícola; LCI - Letra de Crédito Imobiliário; DER COMP - Debênture Compromissada; CDB Vinc - Certificado de Depósito Interbancário Vinculado; CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários; COCA - Certificado de Direitos Creditórios do Agronegócio; CPR - Contas a Pagar e Receber; DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial; COMP - Operação Compromissada; LH - Letra Hipotecária; TERMO - Contrato a Termo.



Informações relevantes

ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - CNPJ 16.718.302/0001-30 - 31/12/2019

Este fundo possui lâmina de informações essenciais, podendo esta ser consultada no seguinte endereço eletrônico www.itaui.com.br. Os rendimentos serão tributados no momento do resgate, à alíquota de 15%. Público Alvo: O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A. Objetivo do fundo: Proporcionar retorno no longo prazo por meio da aplicação em outros fundos de investimento que aloquem em em ações com preços deprimidos... Tipo Anbima: AÇÕES LIVRE - Fundos que têm como objetivo superar um índice de referência ou que não fazem referência a nenhum índice. A seleção dos ativos para compor a Carteira deve ser suportada por um processo de investimento que busca atingir os objetivos e executar a política de investimentos definidos para o fundo. Fundos que não possuem obrigatoriamente o compromisso de concentração em uma estratégia específica. A parcela em caixa pode ser investida em quaisquer ativos, desde que especificados em regulamento. Início do fundo em: 31/10/2012. Taxa de Administração máx.: 2,50%. Taxa de Performance: 20% do que exceder 100% do IBOVESPA FECHAMENTO. Fonte de dados do material: Itaú Asset Management. Material de divulgação do fundo - A Itaú Asset Management é o segmento do Itaú Unibanco especializado em gestão de recursos de clientes. Leia a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Para obter mais informações, entre em contato pelo telefone (11) 3611-2555. Consultas, sugestões, reclamações, críticas, elogios e denúncias, utilize o SAC: 0800 728 9728, todos os dias, 24 horas, ou o canal Fale Conosco (www.itaui.com.br). Se necessário contate a Ouvidoria Corporativa Itaú: 0800 570 0011 (em dias úteis das 9h às 18h) ou Caixa Postal 67 600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, todos os dias, 24 horas: 0800 722 1722.

Outras informações relevantes

* O Itaú Personalite considera seu volume global de investimentos, ou seja, a soma dos valores já investidos em CDB, operações compromissadas, poupança, previdência, fundos e Itaú Corretora, como valor mínimo para a entrada em novos investimentos. Para outros segmentos do Itaú Unibanco, o volume global é correspondente ao valor mínimo de aplicação.

Relatório de Carteira Diária - Fechamento



de Emissão: 30/01/2020 16:37:13

da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

nte: ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FICFI [FICFIS2201] [] [01]

001/002

DOS DE INVESTIMENTO - OUTROS FUNDOS

cdgo	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Qtde Bloq.	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
dos de Renda Variável											
1	CAIXA ACOES	ITAÚ	34.154.16989	0,00000	45.942090	0,00	1.569.113,95	0,00	1.569.113,95	0,17%	0,18%
1	MOMENTO ACOES FI	ITAÚ	7.779.138.55912	0,00000	115,903180	(1.611,991,28)	901.626.896,66	0,00	900.014.905,38	99,83%	100,51%
Fundos de Renda Variável											
			7.813.292.72901				903.196.010,61	0,00	901.584.019,33	100,00%	100,69%
			7.813.292.72901				903.196.010,61	0,00	901.584.019,33	100,00%	100,69%

ITAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Recebimento de Livro em 31/12/20	(297,72)	0,00%	(0,00%)
Despesa com Resgatar	(1.720.352,86)	27,98%	(0,19%)
Despesa com CETIP 08/01/2020	(1.924,93)	0,03%	(0,00%)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 26/01/2021	(322,56)	0,01%	(0,00%)
Despesa de Cartorio - Atas/Livros Eletronicos com pagamento 31/12/2021	(25,73)	0,00%	(0,00%)
Despesas com Auditoria em 27/01/20	(3.840,00)	0,06%	(0,00%)
Despesas com Auditoria em 31/12/20	(5.793,06)	0,09%	(0,00%)
Despesas com Impressos em 24/01/20	(288,98)	0,00%	(0,00%)
Despesa de despesa de Taxa Bimestral ANBID com vencimento 31/01/2020	557,67	(0,01%)	0,00%
Despesa com FEE a pagar em 08/01/2020	(5.789.934,59)	94,17%	(0,65%)
Despesa com FEE de Resgate a Pagar em 08/01/2020	(204.684,22)	3,33%	(0,02%)
Despesa do Fundo MOMENTO ACOES FI [50461]	3.214.414,30	(52,28%)	0,36%
Despesa de Administração a Pagar em 08/01/2020	(1.636.159,24)	26,61%	(0,18%)
AL GERAL	(6.148.651,92)	100,00%	(0,69%)

OURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Despesa em Tesouraria	10.000,00	100,00%	0,00%
Despesa em Tesouraria RESERVA	0,00	0,00%	0,00%
AL	10.000,00	100,00%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



Data de Emissão: 30/01/2020 16:37:13

Data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

Índice: ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FICFI [FICFI52201] [101]

002/002

895.445.367,41	100,00%
----------------	---------

RENTABILIDADE ACUMULADA					
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual
Inicial					
Final					
ALÍQUIDA	-37,6962%	-0,0235%	-0,006419%	9,4500%	35,4565%
✓FECH	0,0000%	-0,0064%	0,0170890%	0,3766%	2,8073%
			0,0000000%	6,8482%	14,5375%
					31,5837%
					35,4565%
					5,9678%
					31,5837%

Intidade de Cotas	32.191.668,06356
Intidade de Cotas (Bruta)	27.816059
Intidade de Cotas (Bruta)	0,00000
Intidade de Cotas (Bruta)	0,000000
Intidade de Cotas (Bruta)	27.816059



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

a de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

a da Posição: 31/12/2019 Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



001/034

NDA VARIÁVEL

ÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL. MERC E FUTUROS

Cód.	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio s/ Correção	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
EV3	AMBEV S/A ON	63.311	0	63.311	18,29	1.157.963,27	24.053,10	1.182.016,37	0,00	1.182.016,37	1,30%	0,79%
JL4	AZUL PN N2	6.235	0	6.235	40,59	253.109,33	110.266,47	363.375,80	0,00	363.375,80	0,40%	0,24%
WJ3	B2W DIGITAL ON	4.106	0	4.106	40,59	166.673,31	91.429,85	258.103,16	0,00	258.103,16	0,28%	0,17%
JA3	B3 ON NM	54.387	0	54.387	37,61	2.045.305,03	291.704,36	2.337.009,39	0,00	2.337.009,39	2,58%	1,56%
SE3	BBSEGURIDADEON	14.908	0	14.908	29,93	446.260,96	115.770,64	562.031,60	0,00	562.031,60	0,62%	0,37%
VIL3	BR MALLS PARON	15.184	0	15.184	13,07	198.443,78	75.779,26	274.223,04	0,00	274.223,04	0,30%	0,18%
DC3	BRADESCO ON I	30.329	0	30.329	31,38	951.677,01	81.632,02	1.033.309,03	0,00	1.033.309,03	1,14%	0,69%
DC4	BRADESCO PN I	78.150	21.962	100.112	35,61	3.565.316,31	55.734,73	3.621.051,04	0,00	3.621.051,04	4,00%	2,41%
AP4	BRADSPAR PN I	5.772	0	5.772	31,85	183.839,82	37.112,34	220.952,16	0,00	220.952,16	0,24%	0,15%
AS3	BRASIL ON NM	36.761	0	36.761	49,48	1.819.031,29	122.684,73	1.941.716,02	0,00	1.941.716,02	2,14%	1,29%
KM5	BRASKEM PNA I	3.734	0	3.734	42,45	158.521,39	(47.061,49)	111.459,90	0,00	111.459,90	0,12%	0,07%
FS3	BRF SA ON NM	20.765	0	20.765	31,65	657.277,62	73.650,38	730.928,00	0,00	730.928,00	0,81%	0,49%
AC11	BTGP BANCO UNT	4.942	0	4.942	59,70	295.012,69	81.221,77	376.234,46	0,00	376.234,46	0,42%	0,25%
RO3	CCR SA ON NM	27.439	0	27.439	13,04	357.727,53	163.064,69	520.792,22	0,00	520.792,22	0,57%	0,35%
IIG4	CEMIG PN N1	24.158	0	24.158	14,52	350.655,14	(17.516,32)	333.138,82	0,00	333.138,82	0,37%	0,22%
IL3	CIELO ON NM	14.250	0	14.250	7,58	108.036,11	11.236,39	119.272,50	0,00	119.272,50	0,13%	0,08%
GN3	COGNAON ON I	26.573	0	26.573	10,03	266.580,33	37.149,06	303.729,39	0,00	303.729,39	0,34%	0,20%
AN3	COSAN ON NV	2.493	0	2.493	49,02	122.209,06	51.228,95	173.438,01	0,00	173.438,01	0,19%	0,12%
CB3	CVC BRASIL ON I	2.341	0	2.341	54,47	127.519,69	(24.983,89)	102.535,80	0,00	102.535,80	0,11%	0,07%
RE3	CYRELA REALTON	3.717	0	3.717	19,80	73.605,84	36.751,89	110.357,73	0,00	110.357,73	0,12%	0,07%
OR3	ECORODOVIAS ON	3.747	0	3.747	9,49	35.541,63	25.534,47	61.076,10	0,00	61.076,10	0,07%	0,04%
ET3	ELETROBRAS ON	4.576	0	4.576	34,54	158.060,58	14.912,22	172.972,80	0,00	172.972,80	0,19%	0,12%
ET6	ELETROBRAS PNB	5.873	0	5.873	36,09	211.952,86	12.630,66	224.583,52	0,00	224.583,52	0,25%	0,15%
IBR3	EMBRAR ON I	19.528	0	19.528	19,19	374.782,61	10.504,83	385.287,44	0,00	385.287,44	0,43%	0,26%
BR3	ENERGIAS BR ON	7.891	0	7.891	18,11	142.869,97	31.521,13	174.391,10	0,00	174.391,10	0,19%	0,12%
IE3	ENGIE BRASIL ON	5.406	0	5.406	44,90	242.706,52	31.918,28	274.624,80	0,00	274.624,80	0,30%	0,18%
TL3	EQUATORIAL ON	27.000	0	27.000	17,35	468.532,29	146.777,71	615.330,00	0,00	615.330,00	0,68%	0,41%
RY3	FLEURY ON NV	7.323	0	7.323	21,79	159.579,15	63.992,04	223.571,19	0,00	223.571,19	0,25%	0,15%
IBR4	GERDAU PN N1	20.117	0	20.117	14,19	285.360,87	116.979,13	402.340,00	0,00	402.340,00	0,44%	0,27%
IAU4	GERDAU MET PN	16.098	0	16.098	6,76	108.899,36	40.490,08	149.389,44	0,00	149.389,44	0,16%	0,10%
ILA4	GOL PN N2	2.701	0	2.701	26,06	70.390,62	29.006,18	99.396,80	0,00	99.396,80	0,11%	0,07%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



002/034

ta de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

ta da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

ÔES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL. MERC E FUTUROS

Cód.	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio s/ Correção	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
CO3	GRUPO NATURAON	4.919	0	4.919	28,76	38,67	141.469,71	48.748,02	190.217,73	0,00	190.217,73	0,21%	0,13%
PE3	HYPERA ON N	10.848	0	10.848	29,34	35,69	318.244,37	68.920,75	387.165,12	0,00	387.165,12	0,43%	0,26%
A3	IGUATEMI ON N	2.400	0	2.400	40,47	52,90	97.122,44	29.837,56	126.960,00	0,00	126.960,00	0,14%	0,08%
DI3	INTERMEDICA ON	9.900	0	9.900	56,64	68,25	560.688,00	114.987,00	675.675,00	0,00	675.675,00	0,75%	0,45%
IR3	IRBRASIL REON	15.739	0	15.739	34,18	38,95	537.919,98	75.114,07	613.034,05	0,00	613.034,05	0,68%	0,41%
VV11	IT NOW IBOV CI	379.883	8.800	388.683	105,95	116,25	41.181.220,26	4.003.178,49	45.184.398,75	0,00	45.184.398,75	49,85%	30,13%
A4	ITAUSA PN N1	121.353	0	121.353	12,32	14,09	1.495.223,18	214.640,59	1.709.863,77	0,00	1.709.863,77	1,89%	1,14%
IB4	ITAUNIBANCOPN	78.635	0	78.635	34,47	37,10	2.710.647,74	206.710,76	2.917.358,50	0,00	2.917.358,50	3,22%	1,95%
S3	JBS ON NM	34.970	0	34.970	21,72	25,80	759.562,79	142.663,21	902.226,00	0,00	902.226,00	1,00%	0,60%
3N11	KLABIN S/A UNT 1	8.968	0	8.968	16,46	18,41	147.619,85	17.481,03	165.100,88	0,00	165.100,88	0,18%	0,11%
NT3	LOCALIZA ON N	15.069	0	15.069	37,15	47,41	559.742,51	154.678,78	714.421,29	0,00	714.421,29	0,79%	0,48%
ME2	LOJAS AMERICDP 1	170	0	170	0,00	9,40	0,00	1.598,00	1.598,00	0,00	1.598,00	0,00%	0,00%
ME4	LOJAS AMERICPN	18.287	0	18.287	16,63	25,91	304.140,82	169.675,35	473.816,17	0,00	473.816,17	0,52%	0,32%
EN3	LOJAS RENNERON	20.599	0	20.599	45,41	56,19	935.460,12	221.997,69	1.157.457,81	0,00	1.157.457,81	1,28%	0,77%
LU3	MAGAZ LUIZA ON	18.000	0	18.000	30,83	47,70	554.950,73	303.649,27	858.600,00	0,00	858.600,00	0,95%	0,57%
FG3	MARFRIG ON N	10.056	0	10.056	7,90	9,96	79.406,57	20.751,19	100.157,76	0,00	100.157,76	0,11%	0,07%
VE3	MRV ON NM	4.803	0	4.803	15,63	21,55	75.066,63	28.438,02	103.504,65	0,00	103.504,65	0,11%	0,07%
LT3	MULTIPLAN ON 1	4.596	0	4.596	25,38	33,10	116.666,70	35.460,90	152.127,60	0,00	152.127,60	0,17%	0,10%
AR4	PACUCAR-CBDPN	450	0	450	93,12	87,65	41.906,06	(2.463,56)	39.442,50	0,00	39.442,50	0,04%	0,03%
TR3	PETROBRAS ON	77.657	0	77.657	30,20	32,00	2.345.332,25	139.691,75	2.485.024,00	0,00	2.485.024,00	2,74%	1,66%
TR4	PETROBRAS PN 1	116.413	0	116.413	27,45	30,18	3.196.019,35	317.324,99	3.513.344,34	0,00	3.513.344,34	3,88%	2,34%
DT3	PETROBRAS BRON	19.441	0	19.441	25,94	30,07	504.296,86	80.294,01	584.590,87	0,00	584.590,87	0,65%	0,39%
AL3	QUALICORP ON	6.100	0	6.100	20,90	37,10	127.489,75	98.820,25	226.310,00	0,00	226.310,00	0,25%	0,15%
DL3	RAIADROGASILON	5.520	0	5.520	77,01	111,64	425.089,00	191.163,80	616.252,80	0,00	616.252,80	0,68%	0,41%
IL3	RUMO S.A. ON N	28.195	0	28.195	19,39	26,10	546.681,65	189.207,85	735.889,50	0,00	735.889,50	0,81%	0,49%
SP3	SABESP ON NV	8.821	0	8.821	48,85	60,56	430.928,37	103.271,39	534.199,76	0,00	534.199,76	0,59%	0,36%
NB11	SANTANDER BRUNT	7.613	0	7.613	45,25	49,52	344.516,38	32.479,38	376.995,76	0,00	376.995,76	0,42%	0,25%
NA3	SID NACIONALON	9.398	0	9.398	14,41	14,11	135.430,97	(2.825,19)	132.605,78	0,00	132.605,78	0,15%	0,09%
LS3	SMILES ON NM	1.600	0	1.600	45,70	39,27	73.118,38	(10.286,38)	62.832,00	0,00	62.832,00	0,07%	0,04%
ZB3	SUZANO S.A. ON 1	14.590	0	14.590	38,57	39,68	562.693,26	16.237,94	578.931,20	0,00	578.931,20	0,64%	0,39%
EE11	TAEASA UNT N2	5.900	0	5.900	26,87	31,18	158.515,25	25.446,75	183.962,00	0,00	183.962,00	0,20%	0,12%
TT4	TELEF BRASILPN	5.935	0	5.935	48,34	57,98	286.925,77	57.185,53	344.111,30	0,00	344.111,30	0,38%	0,23%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

data de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



003/034

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

Cód.	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio s/ Correção	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
IP3	TIM PART S/AON	19.560	0	19.560	11,77	230.243,00	76.262,20	306.505,20	0,00	306.505,20	0,34%	0,20%
PA3	ULTRAPAR ON	27.760	0	27.760	20,70	574.519,39	132.805,41	707.324,80	0,00	707.324,80	0,78%	0,47%
M5	USIMINAS PNA	6.631	0	6.631	8,50	56.368,32	6.692,49	63.060,81	0,00	63.060,81	0,07%	0,04%
LE3	VALE ON NM	76.960	0	76.960	49,60	3.816.977,94	284.990,06	4.101.968,00	0,00	4.101.968,00	4,53%	2,74%
AR3	VIAREJO ON	23.192	0	23.192	6,45	149.525,62	109.529,02	259.054,64	0,00	259.054,64	0,29%	0,17%
GE3	WEG ON NM	14.795	0	14.795	20,12	297.737,88	215.056,82	512.794,70	0,00	512.794,70	0,57%	0,34%
UQ3	YDUQS PART ON	7.879	0	7.879	29,57	232.950,00	141.302,50	374.252,50	0,00	374.252,50	0,41%	0,25%
TOTAL BOLSA		1.803.420	30.762	1.834.182		80.675.879,82	9.955.893,35	90.631.773,17	0,00	90.631.773,17	100,00%	60,44%
IAL		1.803.420	30.762	1.834.182		80.675.879,82	9.955.893,35	90.631.773,17	0,00	90.631.773,17	100,00%	60,44%

IPRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

Operações Doadoras

Cód. Operação	Dt. Operação	Dt. Vencido	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação				
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Líq	% S/ EA % S/ Total	
6122	09/10/2019	07/01/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	188		52,89	9.943,32	0,50%	0,00%	10,63	0,00	10,63	0,07%	0,01%
7483	10/10/2019	08/01/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN	868		33,08	28.713,44	0,13%	0,00%	7,84	0,00	7,84	0,21%	0,02%
10153	14/10/2019	13/01/2020	USIM5	USIMINAS PNA	229		7,67	1.756,43	2,15%	0,00%	7,57	0,00	7,57	0,01%	0,00%
10158	14/10/2019	13/01/2020	USIM5	USIMINAS PNA	259		7,67	1.986,53	2,15%	0,00%	8,57	0,00	8,57	0,01%	0,00%
10163	14/10/2019	13/01/2020	USIM5	USIMINAS PNA	163		7,67	1.250,21	2,15%	0,00%	5,39	0,00	5,39	0,01%	0,00%
11665	16/10/2019	14/01/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	3.179		104,87	333.381,73	0,28%	0,00%	181,30	0,00	181,30	2,40%	0,22%
11688	16/10/2019	14/01/2020	BRML3	BR MALLS PARON	293		14,61	4.280,73	0,10%	0,00%	0,83	0,00	0,83	0,03%	0,00%
12327	16/10/2019	14/01/2020	MULT3	MULTIPLAN ON	1.046		28,88	30.208,48	0,26%	0,00%	15,25	0,00	15,25	0,22%	0,02%
12331	16/10/2019	14/01/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	6.059		104,87	635.407,33	0,28%	0,00%	345,55	0,00	345,55	4,58%	0,42%
13192	17/10/2019	15/01/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	1.387		105,92	146.911,04	0,28%	0,00%	78,26	0,00	78,26	1,06%	0,10%
13470	17/10/2019	15/01/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	323		105,92	34.212,16	0,28%	0,00%	18,22	0,00	18,22	0,25%	0,02%
14225	18/10/2019	03/03/2020	CVCB3	CVC BRASIL ON	132		52,66	6.951,12	0,20%	0,00%	2,59	0,00	2,59	0,05%	0,00%
17664	22/10/2019	20/01/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN	199		34,58	6.881,42	0,05%	0,00%	0,61	0,00	0,61	0,05%	0,00%
18505	23/10/2019	21/01/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN	138		35,51	4.900,38	0,07%	0,00%	0,59	0,00	0,59	0,04%	0,00%
19992	24/10/2019	22/01/2020	WEGE3	WEG ON NM	218		25,71	5.604,78	0,18%	0,00%	1,72	0,00	1,72	0,04%	0,00%
11285	28/10/2019	27/01/2020	EGIE3	ENGIE BRASIL ON	211		43,67	9.214,37	0,14%	0,00%	2,09	0,00	2,09	0,07%	0,01%
12667	29/10/2019	27/01/2020	SANB11	SANTANDER BRUNT	709		49,50	35.095,50	0,22%	0,00%	12,24	0,00	12,24	0,25%	0,02%
12790	29/10/2019	27/01/2020	CIEL3	CIELO ON NM	696		7,89	5.491,44	0,45%	0,00%	3,91	0,00	3,91	0,04%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Itaú Banco Itaú

004/034

de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

de Posição: 31/12/2019

nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

erações Doadoras

Cód. eração	Dt. Operação	Dt. Vento.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Remun/Rep.		IR	Remun/Rep. Liq	% S/ EA	% S/ Total
											Bruto					
3665	30/10/2019	28/01/2020	BRFS3	BRF SA ON NM	788		35,94	28.320,72	0,10%	0,00%	4,38		0,00	4,38	0,20%	0,02%
3507	31/10/2019	30/01/2020	CCRO3	CCR SA ON NM	109		16,62	1.811,58	0,15%	0,00%	0,40		0,00	0,40	0,01%	0,00%
3509	31/10/2019	30/01/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	193		17,45	3.367,85	0,09%	0,00%	0,45		0,00	0,45	0,02%	0,00%
3511	31/10/2019	30/01/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	106		108,90	11.543,40	0,45%	0,00%	7,81		0,00	7,81	0,08%	0,01%
3517	31/10/2019	30/01/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	3.045		108,90	331.600,50	0,45%	0,00%	224,58		0,00	224,58	2,39%	0,22%
3047	04/11/2019	03/02/2020	CMIG4	CEMIG PN N1	162		13,47	2.182,14	0,10%	0,00%	0,31		0,00	0,31	0,02%	0,00%
3051	04/11/2019	03/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	6.569		108,69	713.984,61	0,57%	0,00%	579,97		0,00	579,97	5,14%	0,48%
3707	06/11/2019	04/02/2020	ITUB4	ITAUBANCO PN	7.354		37,26	274.010,04	0,08%	0,00%	29,56		0,00	29,56	1,97%	0,18%
1937	07/11/2019	05/02/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	804		7,62	6.126,48	0,75%	0,00%	5,99		0,00	5,99	0,04%	0,00%
2151	08/11/2019	06/02/2020	KLB11	KLabin S/A UNT N2	503		17,57	8.837,71	0,16%	0,00%	1,79		0,00	1,79	0,06%	0,01%
2153	08/11/2019	06/02/2020	VIVT4	TELEF BRASIL PN	101		54,46	5.500,46	0,29%	0,00%	2,02		0,00	2,02	0,04%	0,00%
5197	12/11/2019	10/02/2020	SANB11	SANTANDER BRUNT	546		46,47	25.372,62	0,37%	0,00%	11,15		0,00	11,15	0,18%	0,02%
5213	12/11/2019	10/02/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	283		31,37	8.877,71	0,25%	0,00%	2,63		0,00	2,63	0,06%	0,01%
5214	12/11/2019	10/02/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	368		7,94	2.921,92	0,90%	0,00%	3,11		0,00	3,11	0,02%	0,00%
5604	12/11/2019	10/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	1.475		108,85	160.553,75	0,83%	0,00%	158,06		0,00	158,06	1,16%	0,11%
5606	12/11/2019	10/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	5.526		108,85	601.505,10	0,83%	0,00%	592,18		0,00	592,18	4,33%	0,40%
5614	12/11/2019	10/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	1.738		108,85	189.181,30	0,83%	0,00%	186,24		0,00	186,24	1,36%	0,13%
5618	12/11/2019	10/02/2020	WEGE3	WEG ON NM	290		28,82	8.357,80	0,14%	0,00%	1,39		0,00	1,39	0,06%	0,01%
6496	13/11/2019	11/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	2.099		107,15	224.907,85	0,73%	0,00%	188,33		0,00	188,33	1,62%	0,15%
6507	13/11/2019	11/02/2020	WEGE3	WEG ON NM	269		28,61	7.696,09	0,15%	0,00%	1,32		0,00	1,32	0,06%	0,01%
7024	13/11/2019	11/02/2020	VIVT4	TELEF BRASIL PN	838		53,87	45.143,06	0,35%	0,00%	18,15		0,00	18,15	0,33%	0,03%
7025	13/11/2019	11/02/2020	FLRY3	FLEURY ON NM	535		25,73	13.765,55	0,40%	0,00%	6,32		0,00	6,32	0,10%	0,01%
7026	13/11/2019	11/02/2020	BRML3	BR MALLS PARON N	107		14,97	1.601,79	0,10%	0,00%	0,18		0,00	0,18	0,01%	0,00%
7029	13/11/2019	11/02/2020	CSAN3	COSAN ON NM	131		57,68	7.556,08	0,14%	0,00%	1,21		0,00	1,21	0,05%	0,01%
7032	13/11/2019	11/02/2020	SANB11	SANTANDER BRUNT	200		45,97	9.194,00	0,35%	0,00%	3,69		0,00	3,69	0,07%	0,01%
7042	13/11/2019	09/01/2020	CIEL3	CIELO ON NM	834		7,90	6.588,60	0,45%	0,00%	3,40		0,00	3,40	0,05%	0,00%
7155	13/11/2019	11/02/2020	COGN3	COGNA ON NM	547		10,90	5.962,30	0,10%	0,00%	0,68		0,00	0,68	0,04%	0,00%
7280	14/11/2019	12/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	2.879		106,44	306.440,76	0,73%	0,00%	247,75		0,00	247,75	2,21%	0,20%
7772	14/11/2019	12/02/2020	CSAN3	COSAN ON NM	276		58,39	16.115,64	0,14%	0,00%	2,50		0,00	2,50	0,12%	0,01%
7773	14/11/2019	12/02/2020	SANB11	SANTANDER BRUNT	198		45,16	8.941,68	0,35%	0,00%	3,47		0,00	3,47	0,06%	0,01%
7954	18/11/2019	17/02/2020	CCRO3	CCR SA ON NM	576		17,44	10.045,44	0,18%	0,00%	1,93		0,00	1,93	0,07%	0,01%
8558	18/11/2019	17/02/2020	BRML3	BR MALLS PARON N	1.577		15,71	24.774,67	0,08%	0,00%	2,12		0,00	2,12	0,18%	0,02%

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

da Posição: 31/12/2019 Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ite: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



005/034

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

Ações Doadoras

Ord.	Ação	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação		Remun/Rep. Liq	% S/ EA	% S/ Total
												Remun/Rep. Bruto	IR			
181		19/11/2019	14/01/2020	IRBR3	IRBBRASIL REON NI	1.644		36,81	60.515,64	0,13%	0,00%	8,11	0,00	8,11	0,44%	0,04%
700		19/11/2019	17/02/2020	UGPA3	ULTRAPAR ON NM	400		20,52	8.208,00	0,18%	0,00%	1,52	0,00	1,52	0,06%	0,01%
702		19/11/2019	17/02/2020	BRAP4	BRADESPAR PN N	190		32,40	6.156,00	0,31%	0,00%	1,96	0,00	1,96	0,04%	0,00%
706		19/11/2019	17/02/2020	ITSA4	ITAUSA PN N1	185		13,69	2.532,65	0,20%	0,00%	0,52	0,00	0,52	0,02%	0,00%
710		19/11/2019	10/01/2020	BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	199		53,98	10.742,02	0,51%	0,00%	5,63	0,00	5,63	0,08%	0,01%
714		19/11/2019	17/02/2020	CCRO3	CCR SA ON NM	254		17,44	4.429,76	0,18%	0,00%	0,82	0,00	0,82	0,03%	0,00%
253		21/11/2019	19/02/2020	WEGE3	WEG ON NM	172		29,25	5.031,00	0,18%	0,00%	0,89	0,00	0,89	0,04%	0,00%
254		21/11/2019	19/02/2020	SANB11	SANTANDER BRUNT	167		45,32	7.568,44	0,25%	0,00%	1,87	0,00	1,87	0,05%	0,01%
261		21/11/2019	19/02/2020	BRFS3	BRF SA ON NM	210		33,62	7.060,20	0,12%	0,00%	0,84	0,00	0,84	0,05%	0,00%
267		21/11/2019	17/02/2020	EGIE3	ENGIE BRASILON N	232		44,56	10.337,92	0,10%	0,00%	1,02	0,00	1,02	0,07%	0,01%
481		21/11/2019	19/02/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	4.189		17,57	73.600,73	0,10%	0,00%	7,29	0,00	7,29	0,53%	0,05%
485		21/11/2019	19/02/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	421		28,12	11.838,52	0,25%	0,00%	2,93	0,00	2,93	0,09%	0,01%
487		21/11/2019	19/02/2020	CSAN3	COSAN ON NM	190		60,92	11.574,80	0,20%	0,00%	2,29	0,00	2,29	0,08%	0,01%
491		21/11/2019	19/02/2020	CCRO3	CCR SA ON NM	200		17,01	3.402,00	0,20%	0,00%	0,67	0,00	0,67	0,02%	0,00%
1138		22/11/2019	20/02/2020	CSNA3	SID NACIONALON	933		11,86	11.065,38	0,17%	0,00%	1,79	0,00	1,79	0,08%	0,01%
1144		22/11/2019	20/02/2020	BRML3	BR MALLS PARON N	561		15,59	8.745,99	0,09%	0,00%	0,74	0,00	0,74	0,06%	0,01%
1156		22/11/2019	20/02/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	238		27,64	6.578,32	0,25%	0,00%	1,56	0,00	1,56	0,05%	0,00%
1252		22/11/2019	20/02/2020	BBDCA	BRADESCO PN N1	110		33,26	3.658,60	0,07%	0,00%	0,24	0,00	0,24	0,03%	0,00%
1263		22/11/2019	20/02/2020	BBDCA	BRADESCO PN N1	22		33,26	731,72	0,07%	0,00%	0,04	0,00	0,04	0,01%	0,00%
1339		22/11/2019	06/01/2020	FLRY3	FLEURY ON NM	172		27,59	4.745,48	0,25%	0,00%	1,12	0,00	1,12	0,03%	0,00%
1342		22/11/2019	20/02/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	228		16,12	3.675,36	0,10%	0,00%	0,34	0,00	0,34	0,03%	0,00%
1344		22/11/2019	20/02/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	108		55,21	5.962,68	0,30%	0,00%	1,70	0,00	1,70	0,04%	0,00%
1096		22/11/2019	20/02/2020	COGN3	COGNA ON NM	916		10,42	9.544,72	0,07%	0,00%	0,63	0,00	0,63	0,07%	0,01%
1097		22/11/2019	20/02/2020	COGN3	COGNA ON NM	143		10,42	1.490,06	0,15%	0,00%	0,21	0,00	0,21	0,01%	0,00%
1088		25/11/2019	27/02/2020	MRVE3	MRV ON NM	205		17,83	3.655,15	6,70%	0,00%	21,69	0,00	21,69	0,03%	0,00%
1106		25/11/2019	27/02/2020	CIEL3	CIELO ON NM	385		7,57	2.914,45	0,80%	0,00%	2,12	0,00	2,12	0,02%	0,00%
3548		26/11/2019	28/02/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	246		8,35	2.054,10	0,29%	0,00%	0,51	0,00	0,51	0,01%	0,00%
3562		26/11/2019	28/02/2020	IRBR3	IRBBRASIL REON NI	129		37,32	4.814,28	0,15%	0,00%	0,63	0,00	0,63	0,03%	0,00%
7158		27/11/2019	28/02/2020	CSNA3	SID NACIONALON	130		12,69	1.649,70	0,25%	0,00%	0,34	0,00	0,34	0,01%	0,00%
7164		27/11/2019	28/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	4.328		107,55	465.476,40	0,63%	0,00%	243,67	0,00	243,67	3,35%	0,31%
7165		27/11/2019	28/02/2020	CSNA3	SID NACIONALON	1.169		12,69	14.834,61	0,21%	0,00%	2,59	0,00	2,59	0,11%	0,01%
7170		27/11/2019	28/02/2020	KLB11	KLABIN S/A UNT N2	319	-319	17,51	5.585,69	0,16%	0,00%	0,74	0,00	0,74	0,04%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



006/034

de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17.5438

da Posição: 31/12/2019

nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

erações Doadoras

Cód. Operação	Dt.	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
										Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Liq		
172	27/11/2019	28/02/2020	CSNA3	SID NACIONALON	252	12,69	3.197,88	0,17%	0,00%	0,45	0,00	0,45	0,02%	0,00%
788	28/11/2019	28/02/2020	CIEL3	CIELO ON NM	698	7,48	5.221,04	7,30%	0,00%	29,27	0,00	29,27	0,04%	0,00%
789	28/11/2019	28/02/2020	ELET3	ELETOBRAS ON	1.708	34,47	58.874,76	2,90%	0,00%	133,72	0,00	133,72	0,42%	0,04%
790	28/11/2019	28/02/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	857	34,15	29.266,55	0,11%	0,00%	2,55	0,00	2,55	0,21%	0,02%
791	28/11/2019	28/02/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	4.207	108,11	454.818,77	0,63%	0,00%	226,75	0,00	226,75	3,28%	0,30%
796	28/11/2019	28/02/2020	ELET3	ELETOBRAS ON	534	34,47	18.406,98	3,00%	0,00%	43,23	0,00	43,23	0,13%	0,01%
797	28/11/2019	20/01/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	270	27,77	7.497,90	0,22%	0,00%	1,30	0,00	1,30	0,05%	0,00%
798	28/11/2019	28/02/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	1.037	8,37	8.679,69	0,30%	0,00%	2,06	0,00	2,06	0,06%	0,01%
3053	28/11/2019	28/02/2020	BBDC4	BRADESCO PN N1	590	33,26	19.623,40	0,06%	0,00%	0,93	0,00	0,93	0,14%	0,01%
3055	28/11/2019	28/02/2020	EGIE3	ENGIE BRASILON N1	238	45,48	10.824,24	0,29%	0,00%	2,48	0,00	2,48	0,08%	0,01%
3057	28/11/2019	20/01/2020	B2OW3	B2W DIGITAL ON	549	54,91	30.145,59	0,40%	0,00%	9,55	0,00	9,55	0,22%	0,02%
3059	28/11/2019	22/01/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	246	54,83	13.488,18	0,35%	0,00%	3,74	0,00	3,74	0,10%	0,01%
3061	28/11/2019	20/01/2020	GOLLA	GOL PN N2	899	33,15	29.801,85	2,50%	0,00%	58,46	0,00	58,46	0,21%	0,02%
3889	29/11/2019	02/03/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	295	34,36	10.136,20	0,15%	0,00%	1,14	0,00	1,14	0,07%	0,01%
3893	29/11/2019	21/01/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	320	8,42	2.694,40	0,35%	0,00%	0,70	0,00	0,70	0,02%	0,00%
3895	29/11/2019	22/01/2020	EGIE3	ENGIE BRASILON N1	151	46,23	6.980,73	0,30%	0,00%	1,57	0,00	1,57	0,05%	0,00%
3030	29/11/2019	02/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	3	7,65	22,95	7,15%	0,00%	0,11	0,00	0,11	0,00%	0,00%
3454	02/12/2019	02/03/2020	CSNA3	SID NACIONALON	232	12,73	2.953,36	0,25%	0,00%	0,52	0,00	0,52	0,02%	0,00%
3456	02/12/2019	02/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON	127	38,24	4.856,48	0,19%	0,00%	0,65	0,00	0,65	0,03%	0,00%
3458	02/12/2019	02/03/2020	CCRO3	CCR SA ON NM	1.104	17,26	19.055,04	0,14%	0,00%	1,90	0,00	1,90	0,14%	0,01%
3460	02/12/2019	02/03/2020	IRBR3	IRB BRASIL REON N1	591	34,35	20.298,88	0,14%	0,00%	2,02	0,00	2,02	0,15%	0,01%
3462	02/12/2019	02/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	298	7,76	2.312,48	7,20%	0,00%	11,51	0,00	11,51	0,02%	0,00%
3466	02/12/2019	02/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	233	7,76	1.808,08	7,20%	0,00%	9,00	0,00	9,00	0,01%	0,00%
9901	03/12/2019	02/03/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	365	17,99	6.566,35	0,12%	0,00%	0,53	0,00	0,53	0,05%	0,00%
9903	03/12/2019	02/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	166	17,23	2.860,18	0,25%	0,00%	0,48	0,00	0,48	0,02%	0,00%
0362	03/12/2019	02/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	1.542	17,23	26.568,66	0,22%	0,00%	3,93	0,00	3,93	0,19%	0,02%
0369	03/12/2019	02/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	1.066	7,79	8.304,14	7,20%	0,00%	39,03	0,00	39,03	0,06%	0,01%
0755	04/12/2019	03/03/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	534	55,83	29.813,22	0,38%	0,00%	7,18	0,00	7,18	0,21%	0,02%
1037	04/12/2019	03/03/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	295	35,62	10.507,90	0,16%	0,00%	1,06	0,00	1,06	0,08%	0,01%
1038	04/12/2019	03/03/2020	CVCB3	CVC BRASIL ON N1	307	40,62	12.470,34	2,70%	0,00%	21,11	0,00	21,11	0,09%	0,01%
2083	06/12/2019	05/03/2020	ELET3	ELETOBRAS ON	201	35,65	7.165,65	1,85%	0,00%	7,30	0,00	7,30	0,05%	0,00%
2085	06/12/2019	05/03/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	188	8,78	1.650,64	0,40%	0,00%	0,36	0,00	0,36	0,01%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

a de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

a da Posição: 31/12/2019 Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



007/034

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

erações Doadoras

Cód. eração	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Liq		
2087	06/12/2019	05/03/2020	CSAN3	COSAN ON NM	578		65,48	37.847,44	0,25%	0,00%	5,25	0,00	5,25	0,27%	0,03%
2566	06/12/2019	05/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	47		56,57	2.658,79	0,34%	0,00%	0,50	0,00	0,50	0,02%	0,00%
2568	06/12/2019	05/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	113		56,57	6.392,41	0,34%	0,00%	1,20	0,00	1,20	0,05%	0,00%
2912	09/12/2019	21/01/2020	CIEL3	CIELO ON NM	126		8,07	1.016,82	6,10%	0,00%	3,11	0,00	3,11	0,01%	0,00%
2913	09/12/2019	09/03/2020	ITUB4	ITAUUNIBANCOPN	2.624		36,13	94.805,12	0,12%	0,00%	5,86	0,00	5,86	0,68%	0,06%
2914	09/12/2019	09/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	253		8,07	2.041,71	6,10%	0,00%	6,24	0,00	6,24	0,01%	0,00%
3200	09/12/2019	21/01/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	430		36,81	15.828,30	0,10%	0,00%	0,81	0,00	0,81	0,11%	0,01%
3977	10/12/2019	09/03/2020	CVCB3	CVC BRASIL ON NM	503		41,41	20.829,23	0,12%	0,00%	1,18	0,00	1,18	0,15%	0,01%
3978	10/12/2019	09/03/2020	CVCB3	CVC BRASIL ON NM	334		41,41	13.830,94	0,12%	0,00%	0,78	0,00	0,78	0,10%	0,01%
3984	10/12/2019	22/01/2020	CIEL3	CIELO ON NM	158		8,12	1.282,96	6,00%	0,00%	3,56	0,00	3,56	0,01%	0,00%
3985	10/12/2019	09/03/2020	JBSS3	JBS ON NM	8.531		26,69	227.692,39	0,08%	0,00%	8,67	0,00	8,67	1,64%	0,15%
3986	10/12/2019	09/03/2020	CVCB3	CVC BRASIL ON NM	224		41,41	9.275,84	0,12%	0,00%	0,52	0,00	0,52	0,07%	0,01%
3988	10/12/2019	09/03/2020	BOVV11	IT NOW BOV CI	186		111,37	20.714,82	0,77%	0,00%	7,56	0,00	7,56	0,15%	0,01%
3990	10/12/2019	09/03/2020	KLBNT1	KLBIN S/A UNT N2	1.649		18,21	30.028,29	0,12%	0,00%	1,71	0,00	1,71	0,22%	0,02%
3991	10/12/2019	09/03/2020	ITUB4	ITAUUNIBANCOPN	1.098		36,42	39.989,16	0,10%	0,00%	1,90	0,00	1,90	0,29%	0,03%
4124	10/12/2019	09/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	602		38,01	22.882,02	0,25%	0,00%	2,72	0,00	2,72	0,16%	0,02%
4785	11/12/2019	10/03/2020	JBSS3	JBS ON NM	359		25,99	9.330,41	0,07%	0,00%	0,28	0,00	0,28	0,07%	0,01%
4789	11/12/2019	10/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	120		8,06	967,20	6,00%	0,00%	2,46	0,00	2,46	0,01%	0,00%
4790	11/12/2019	10/03/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	703		8,70	6.116,10	0,45%	0,00%	1,19	0,00	1,19	0,04%	0,00%
4792	11/12/2019	10/03/2020	B3SA3	B3 ON NM	106		46,95	4.976,70	0,21%	0,00%	0,45	0,00	0,45	0,04%	0,00%
4795	11/12/2019	10/03/2020	BBAS3	BRASIL ON NM	166		48,05	7.976,30	0,10%	0,00%	0,34	0,00	0,34	0,06%	0,01%
4797	11/12/2019	10/03/2020	IRBR3	IRBRASIL REON NI	4.632		36,82	170.550,24	0,18%	0,00%	13,38	0,00	13,38	1,23%	0,11%
4800	11/12/2019	10/03/2020	BDDC4	BRADESCO PN N1	1.098		34,54	37.924,92	0,21%	0,00%	3,47	0,00	3,47	0,27%	0,03%
4803	11/12/2019	10/03/2020	CCRO3	CCR SA ON NM	226		17,11	3.866,86	0,12%	0,00%	0,20	0,00	0,20	0,03%	0,00%
4805	11/12/2019	10/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	1.332		17,56	23.389,92	0,15%	0,00%	1,53	0,00	1,53	0,17%	0,02%
4810	11/12/2019	10/03/2020	PETR3	PETROBRAS ON N	2.000		32,30	64.600,00	0,10%	0,00%	2,81	0,00	2,81	0,47%	0,04%
4812	11/12/2019	10/03/2020	PETR4	PETROBRAS PN N	5.614		30,25	169.823,50	0,35%	0,00%	25,90	0,00	25,90	1,22%	0,11%
4813	11/12/2019	10/03/2020	VVAR3	VIAVAREJO ON NM	223		10,21	2.276,83	0,22%	0,00%	0,21	0,00	0,21	0,02%	0,00%
4815	11/12/2019	10/03/2020	VVAR3	VIAVAREJO ON NM	961		10,21	9.811,81	0,20%	0,00%	0,85	0,00	0,85	0,07%	0,01%
48153	11/12/2019	10/03/2020	PETR4	PETROBRAS PN N	116		30,25	3.509,00	0,40%	0,00%	0,61	0,00	0,61	0,03%	0,00%
48155	11/12/2019	10/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON NM	125		44,44	5.555,00	0,10%	0,00%	0,24	0,00	0,24	0,04%	0,00%
48157	11/12/2019	10/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	100		17,56	1.756,00	0,15%	0,00%	0,11	0,00	0,11	0,01%	0,00%

Relatório de Carteira Diária - Fechamento



008/034

1 de Emissão: 30/01/2020 16:39:38
 1 de Posição: 31/12/2019
 Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17.5438
 nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

erações Doadoras

Cód. eração	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Liq		
3159	11/12/2019	10/03/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	240	-240	36,22	8.692,80	0,16%	0,00%	0,60	0,00	0,60	0,06%	0,01%
3161	11/12/2019	10/03/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	624		36,22	22.601,28	0,16%	0,00%	1,57	0,00	1,57	0,16%	0,02%
3163	11/12/2019	10/03/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	37		36,22	1.340,14	0,16%	0,00%	0,09	0,00	0,09	0,01%	0,00%
3165	11/12/2019	10/03/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	240		8,70	2.088,00	0,45%	0,00%	0,40	0,00	0,40	0,02%	0,00%
3167	11/12/2019	10/03/2020	CSNA3	SID NACIONALON	400		13,23	5.292,00	0,49%	0,00%	1,12	0,00	1,12	0,04%	0,00%
3169	11/12/2019	10/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	103		29,22	3.009,66	0,14%	0,00%	0,18	0,00	0,18	0,02%	0,00%
3171	11/12/2019	10/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	170		29,22	4.967,40	0,14%	0,00%	0,30	0,00	0,30	0,04%	0,00%
3173	11/12/2019	10/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	312		29,22	9.116,64	0,14%	0,00%	0,55	0,00	0,55	0,07%	0,01%
3175	11/12/2019	10/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	336		29,22	9.817,92	0,14%	0,00%	0,59	0,00	0,59	0,07%	0,01%
3179	11/12/2019	10/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	25		29,22	730,50	0,14%	0,00%	0,04	0,00	0,04	0,01%	0,00%
3183	11/12/2019	10/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON N1	786		38,07	29.923,02	0,20%	0,00%	2,60	0,00	2,60	0,22%	0,02%
3185	11/12/2019	10/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON N1	633		38,07	24.098,31	0,20%	0,00%	2,10	0,00	2,10	0,17%	0,02%
3187	11/12/2019	10/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	122		56,54	6.897,88	0,28%	0,00%	0,84	0,00	0,84	0,05%	0,00%
3189	11/12/2019	10/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	28		56,54	1.583,12	0,28%	0,00%	0,19	0,00	0,19	0,01%	0,00%
3191	11/12/2019	10/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	541		8,06	4.360,46	6,00%	0,00%	11,10	0,00	11,10	0,03%	0,00%
3195	11/12/2019	10/03/2020	ELET3	ELETROBRAS ON N1	1.179		35,76	42.161,04	1,73%	0,00%	31,57	0,00	31,57	0,30%	0,03%
3653	12/12/2019	11/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	243		17,64	4.286,52	0,15%	0,00%	0,25	0,00	0,25	0,03%	0,00%
3657	12/12/2019	11/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	29		17,64	511,56	0,15%	0,00%	0,03	0,00	0,03	0,00%	0,00%
3661	12/12/2019	11/03/2020	KLB11	KLabin S/A UNT N2	1.228		18,51	22.730,28	0,16%	0,00%	1,44	0,00	1,44	0,16%	0,02%
7326	12/12/2019	11/03/2020	CYRE3	CYRELA REALTON N1	2.570		27,96	71.857,20	0,12%	0,00%	3,41	0,00	3,41	0,52%	0,05%
7329	12/12/2019	11/03/2020	CMIG4	CEMIG PN N1	949		12,90	12.242,10	0,13%	0,00%	0,63	0,00	0,63	0,09%	0,01%
7332	12/12/2019	10/03/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	832		8,90	7.404,80	0,40%	0,00%	1,17	0,00	1,17	0,05%	0,00%
7334	12/12/2019	11/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	2.084		8,17	17.026,28	5,30%	0,00%	34,92	0,00	34,92	0,12%	0,01%
7339	12/12/2019	11/03/2020	WEGE3	WEG ON NM	118		32,49	3.833,82	0,13%	0,00%	0,19	0,00	0,19	0,03%	0,00%
7341	12/12/2019	11/03/2020	WEGE3	WEG ON NM	434		32,49	14.100,66	0,13%	0,00%	0,72	0,00	0,72	0,10%	0,01%
8374	13/12/2019	12/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	155		55,97	8.675,35	0,30%	0,00%	0,92	0,00	0,92	0,06%	0,01%
8375	13/12/2019	12/03/2020	IRBR3	IRBRASIL REON N1	611		37,37	22.833,07	0,22%	0,00%	1,79	0,00	1,79	0,16%	0,02%
8376	13/12/2019	12/03/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN N1	120		35,70	4.284,00	0,10%	0,00%	0,15	0,00	0,15	0,03%	0,00%
8377	13/12/2019	12/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	3.726		8,36	31.149,36	5,40%	0,00%	58,56	0,00	58,56	0,22%	0,02%
8380	13/12/2019	12/03/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	139		9,20	1.278,80	0,41%	0,00%	0,18	0,00	0,18	0,01%	0,00%
9313	13/12/2019	12/03/2020	EGIE3	ENGIE BRASILON N1	123		47,68	5.864,64	0,22%	0,00%	0,46	0,00	0,46	0,04%	0,00%
9315	13/12/2019	12/03/2020	IRBR3	IRBRASIL REON N1	141		37,37	5.269,17	0,22%	0,00%	0,41	0,00	0,41	0,04%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



009/034

1 de Emissão: 30/01/2020 16:39:38
 1 de Posição: 31/12/2019
 Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - RS 17,5438
 ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

erações Doadoras

Cód. eração	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Liq		
3785	16/12/2019	16/03/2020	WEGE3	WEG ON NM	360		34,06	12.261,60	0,10%	0,00%	0,38	0,00	0,38	0,09%	0,01%
3787	16/12/2019	16/03/2020	CSNA3	SID NACIONAL ON	953		14,18	13.513,54	0,37%	0,00%	1,58	0,00	1,58	0,10%	0,01%
3789	16/12/2019	16/03/2020	VVAR3	VIAVAREJO ON NM	1.024		10,44	10.690,56	0,12%	0,00%	0,40	0,00	0,40	0,08%	0,01%
3792	16/12/2019	16/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	806		18,18	14.653,08	0,16%	0,00%	0,74	0,00	0,74	0,11%	0,01%
3793	16/12/2019	16/03/2020	EGIE3	ENGIE BRASIL ON NM	144		47,73	6.873,12	0,20%	0,00%	0,43	0,00	0,43	0,05%	0,00%
3794	16/12/2019	16/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	658		8,63	5.678,54	5,60%	0,00%	9,83	0,00	9,83	0,04%	0,00%
3680	16/12/2019	16/03/2020	VIVT4	TELEF BRASIL PN	309		56,17	17.356,53	0,25%	0,00%	1,37	0,00	1,37	0,12%	0,01%
0684	16/12/2019	16/03/2020	MRVE3	MRV ON NM	265		21,50	5.697,50	6,00%	0,00%	10,54	0,00	10,54	0,04%	0,00%
0686	16/12/2019	16/03/2020	BOV11	IT NOW BOV CI	152		113,07	17.186,64	0,65%	0,00%	3,53	0,00	3,53	0,12%	0,01%
0690	16/12/2019	07/04/2020	MRVE3	MRV ON NM	119		21,50	2.558,50	6,00%	0,00%	4,73	0,00	4,73	0,02%	0,00%
1783	17/12/2019	12/02/2020	COGN3	COGNA ON NM	117		12,14	1.420,38	0,11%	0,00%	0,04	0,00	0,04	0,01%	0,00%
1787	17/12/2019	16/03/2020	COGN3	COGNA ON NM	1.094		12,14	13.281,16	0,15%	0,00%	0,55	0,00	0,55	0,10%	0,01%
1789	17/12/2019	16/03/2020	COGN3	COGNA ON NM	226		12,14	2.743,64	0,15%	0,00%	0,11	0,00	0,11	0,02%	0,00%
1795	17/12/2019	16/03/2020	VALE3	VALE ON NM	791		54,03	42.737,73	0,08%	0,00%	0,94	0,00	0,94	0,31%	0,03%
1796	17/12/2019	16/03/2020	BRML3	BR MALLS PARON N	4.032		17,44	70.318,08	0,10%	0,00%	1,95	0,00	1,95	0,51%	0,05%
1799	17/12/2019	16/03/2020	LREN3	LOJAS RENNEN ON	452		54,19	24.493,88	0,20%	0,00%	1,35	0,00	1,35	0,18%	0,02%
1800	17/12/2019	10/02/2020	CYRE3	CYRELA REALT ON	278		29,79	8.281,62	0,15%	0,00%	0,34	0,00	0,34	0,06%	0,01%
1804	17/12/2019	16/03/2020	VVAR3	VIAVAREJO ON NM	2.562		11,37	29.129,94	0,18%	0,00%	1,45	0,00	1,45	0,21%	0,02%
1806	17/12/2019	16/03/2020	COGN3	COGNA ON NM	2.092		12,14	25.396,88	0,15%	0,00%	1,05	0,00	1,05	0,18%	0,02%
1808	17/12/2019	16/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	377		8,48	3.196,96	5,40%	0,00%	4,67	0,00	4,67	0,02%	0,00%
1809	17/12/2019	16/03/2020	USIM5	USIMINAS PNA N1	1.108		9,18	10.171,44	0,30%	0,00%	0,84	0,00	0,84	0,07%	0,01%
1810	17/12/2019	16/03/2020	ELET3	ELETROBRAS ON N	384		36,21	13.904,64	2,75%	0,00%	10,48	0,00	10,48	0,10%	0,01%
3242	18/12/2019	17/03/2020	IRBR3	IRB BRASIL REON NI	220		37,13	8.168,60	0,16%	0,00%	0,31	0,00	0,31	0,06%	0,01%
3245	18/12/2019	17/03/2020	WEGE3	WEG ON NM	752		33,81	25.425,12	0,11%	0,00%	0,66	0,00	0,66	0,18%	0,02%
3246	18/12/2019	17/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON NM	440		47,26	20.794,40	0,13%	0,00%	0,64	0,00	0,64	0,15%	0,01%
3247	18/12/2019	17/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA N1	522		28,55	14.903,10	0,30%	0,00%	1,06	0,00	1,06	0,11%	0,01%
3248	18/12/2019	17/03/2020	EGIE3	ENGIE BRASIL ON NM	120		47,47	5.696,40	0,35%	0,00%	0,47	0,00	0,47	0,04%	0,00%
3249	18/12/2019	17/03/2020	SANB11	SANTANDER BRUNT	333		45,02	14.991,66	0,15%	0,00%	0,53	0,00	0,53	0,11%	0,01%
3250	18/12/2019	17/03/2020	MRVE3	MRV ON NM	249		21,83	5.435,67	5,52%	0,00%	6,95	0,00	6,95	0,04%	0,00%
3251	18/12/2019	17/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	7		8,53	59,71	5,40%	0,00%	0,07	0,00	0,07	0,00%	0,00%
14485	18/12/2019	17/03/2020	CYRE3	CYRELA REALT ON N	514		29,49	15.157,86	0,25%	0,00%	0,90	0,00	0,90	0,11%	0,01%
14489	18/12/2019	17/03/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	131		18,99	2.487,69	0,27%	0,00%	0,15	0,00	0,15	0,02%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



Banco Itaú

1 de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

1 de Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

010/034

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BÓLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

erações Doadoras

Cód. eração	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Líq		
1491	18/12/2019	17/03/2020	PETRA	PETROBRAS PN	Nº	134	29,71	3.981,14	0,13%	0,00%	0,12	0,00	0,12	0,03%	0,00%
1493	18/12/2019	17/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON	Nº	219	39,97	8.753,43	0,15%	0,00%	0,31	0,00	0,31	0,06%	0,01%
1495	18/12/2019	17/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON	Nº	524	39,97	20.944,28	0,15%	0,00%	0,74	0,00	0,74	0,15%	0,01%
1497	18/12/2019	17/03/2020	CSNA3	SID NACIONALON	Nº	1.245	13,91	17.317,95	0,30%	0,00%	1,23	0,00	1,23	0,12%	0,01%
1499	18/12/2019	17/03/2020	CSNA3	SID NACIONALON	Nº	257	13,91	3.574,87	0,30%	0,00%	0,25	0,00	0,25	0,03%	0,00%
1503	18/12/2019	17/03/2020	SBSP3	SABESP ON NM	Nº	401	57,89	23.213,89	0,08%	0,00%	0,44	0,00	0,44	0,17%	0,02%
1507	18/12/2019	17/03/2020	BRML3	BR MALLS PARON N	Nº	244	17,34	4.230,96	0,13%	0,00%	0,13	0,00	0,13	0,03%	0,00%
1509	18/12/2019	17/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	Nº	514	57,01	29.303,14	0,26%	0,00%	1,81	0,00	1,81	0,21%	0,02%
1511	18/12/2019	17/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	Nº	1.267	8,53	10.807,51	5,40%	0,00%	13,54	0,00	13,54	0,08%	0,01%
1678	12/12/2019	11/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	129	34,54	4.455,66	2,07%	0,00%	3,62	0,00	3,62	0,03%	0,00%
1682	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	1.564	35,21	55.068,44	2,07%	0,00%	40,31	0,00	40,31	0,40%	0,04%
1686	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	509	35,21	17.921,89	2,07%	0,00%	13,11	0,00	13,11	0,13%	0,01%
1690	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	752	35,21	26.477,92	2,07%	0,00%	19,38	0,00	19,38	0,19%	0,02%
1694	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	720	35,21	25.351,20	2,07%	0,00%	18,55	0,00	18,55	0,18%	0,02%
1698	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	184	35,21	6.478,64	2,07%	0,00%	4,74	0,00	4,74	0,05%	0,00%
1702	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	238	35,21	8.379,98	2,07%	0,00%	6,13	0,00	6,13	0,06%	0,01%
1705	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	300	35,21	10.563,00	2,07%	0,00%	7,73	0,00	7,73	0,08%	0,01%
1709	13/12/2019	12/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	Nº	143	35,21	5.035,03	2,07%	0,00%	3,68	0,00	3,68	0,04%	0,00%
3550	19/12/2019	18/03/2020	COGN3	COGNA ON NM	Nº	1.035	11,71	12.119,85	0,12%	0,00%	0,28	0,00	0,28	0,09%	0,01%
3551	19/12/2019	18/03/2020	BPAC11	BTGP BANCO UNT	Nº	258	74,33	19.177,14	0,12%	0,00%	0,45	0,00	0,45	0,14%	0,01%
3552	19/12/2019	18/03/2020	BTOW3	B2W DIGITAL ON	Nº	193	63,97	12.346,21	0,26%	0,00%	0,63	0,00	0,63	0,09%	0,01%
3553	19/12/2019	18/03/2020	ENBR3	ENERGIAS BR ON N	Nº	100	20,56	2.056,00	0,09%	0,00%	0,03	0,00	0,03	0,01%	0,00%
3554	19/12/2019	18/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON NM	Nº	288	47,45	13.665,60	0,16%	0,00%	0,43	0,00	0,43	0,10%	0,01%
3556	19/12/2019	18/03/2020	MRFG3	MARFRIG ON NM	Nº	344	10,26	3.529,44	6,50%	0,00%	4,41	0,00	4,41	0,03%	0,00%
3557	19/12/2019	18/03/2020	COGN3	COGNA ON NM	Nº	1.467	11,71	17.178,57	0,12%	0,00%	0,40	0,00	0,40	0,12%	0,01%
3559	19/12/2019	18/03/2020	COGN3	COGNA ON NM	Nº	2.038	11,71	23.864,98	0,11%	0,00%	0,52	0,00	0,52	0,17%	0,02%
3560	19/12/2019	18/03/2020	PCAR4	PACUCAR-CBDPN	Nº	1.734	86,96	150.788,64	0,12%	0,00%	3,58	0,00	3,58	1,09%	0,10%
3561	19/12/2019	18/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	Nº	1.569	57,03	89.480,07	0,25%	0,00%	4,43	0,00	4,43	0,64%	0,06%
3562	19/12/2019	18/03/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	Nº	4.275	19,06	81.481,50	0,15%	0,00%	2,42	0,00	2,42	0,59%	0,05%
3563	19/12/2019	18/03/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	Nº	1.786	19,06	34.041,16	0,17%	0,00%	1,14	0,00	1,14	0,25%	0,02%
3564	19/12/2019	18/03/2020	WEGE3	WEG ON NM	Nº	1.980	33,86	67.042,80	0,14%	0,00%	1,86	0,00	1,86	0,48%	0,04%
3568	19/12/2019	18/03/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	Nº	382	19,06	7.280,92	0,18%	0,00%	0,25	0,00	0,25	0,05%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



011/034

de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

Itaú CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

RÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

Ações Doadoras

Ord. Ação	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Líq		
569	19/12/2019	18/03/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	706		19,06	13.456,36	0,18%	0,00%	0,48	0,00	0,48	0,10%	0,01%
571	19/12/2019	18/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	1.410		35,53	50.097,30	0,07%	0,00%	0,69	0,00	0,69	0,36%	0,03%
572	19/12/2019	18/03/2020	COGN3	COGNA ON ON N1	1.328		11,71	15.550,88	0,12%	0,00%	0,37	0,00	0,37	0,11%	0,01%
573	19/12/2019	18/03/2020	LAME4	LOJAS AMERICPN N	328		25,83	8.472,24	0,25%	0,00%	0,41	0,00	0,41	0,06%	0,01%
574	19/12/2019	31/01/2020	EGIE3	ENGIE BRASIL ON N1	112		48,32	5.411,84	0,33%	0,00%	0,35	0,00	0,35	0,04%	0,00%
410	19/12/2019	18/03/2020	GBR4	GERDAU PN N1	171		17,90	3.060,90	0,18%	0,00%	0,10	0,00	0,10	0,02%	0,00%
412	19/12/2019	18/03/2020	CSNA3	SID NACIONAL ON	1.138		13,72	15.613,36	0,30%	0,00%	0,92	0,00	0,92	0,11%	0,01%
416	19/12/2019	18/03/2020	KLB11	KLABIN S/A UNT N2	546		18,79	10.259,34	0,12%	0,00%	0,24	0,00	0,24	0,07%	0,01%
418	19/12/2019	18/03/2020	CSAN3	COSAN ON NM	510		68,94	35.159,40	0,20%	0,00%	1,39	0,00	1,39	0,25%	0,02%
420	19/12/2019	18/03/2020	KLB11	KLABIN S/A UNT N2	533		18,79	10.015,07	0,13%	0,00%	0,25	0,00	0,25	0,07%	0,01%
422	19/12/2019	18/03/2020	KLB11	KLABIN S/A UNT N2	186		18,79	3.494,94	0,13%	0,00%	0,09	0,00	0,09	0,03%	0,00%
424	19/12/2019	18/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	358		35,53	12.719,74	0,10%	0,00%	0,25	0,00	0,25	0,09%	0,01%
426	19/12/2019	18/03/2020	WEG3	WEG ON NM	349		33,86	11.817,14	0,15%	0,00%	0,35	0,00	0,35	0,09%	0,01%
428	19/12/2019	18/03/2020	BOV11	IT NOW IBOV CI	525		114,73	60.233,25	0,73%	0,00%	8,69	0,00	8,69	0,43%	0,04%
430	19/12/2019	18/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON N1	1.803		39,50	71.218,50	0,20%	0,00%	2,82	0,00	2,82	0,51%	0,05%
432	19/12/2019	18/03/2020	BRK15	BRASKEM PNA N1	165		28,80	4.752,00	0,30%	0,00%	0,28	0,00	0,28	0,03%	0,00%
434	19/12/2019	18/03/2020	BTOW3	B2W DIGITAL ON N1	125		63,97	7.996,25	0,26%	0,00%	0,41	0,00	0,41	0,06%	0,01%
630	20/12/2019	19/03/2020	VIVT4	TELEF BRASIL PN N1	127		35,50	3.869,50	7,12%	0,00%	4,22	0,00	4,22	0,03%	0,00%
1031	20/12/2019	19/03/2020	ELET3	ELETRONBRAS ON N1	109		8,52	8.289,96	5,44%	0,00%	6,97	0,00	6,97	0,06%	0,01%
1032	20/12/2019	19/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	973		24,20	20.037,60	0,13%	0,00%	0,41	0,00	0,41	0,14%	0,01%
1033	20/12/2019	19/03/2020	UGPA3	ULTRAPAR ON NM	828		18,82	54.126,32	0,13%	0,00%	1,11	0,00	1,11	0,39%	0,04%
1037	20/12/2019	19/03/2020	KLB11	KLABIN S/A UNT N2	2.876		53,95	398.744,45	0,05%	0,00%	3,16	0,00	3,16	2,87%	0,27%
1038	20/12/2019	19/03/2020	VALE3	VALE ON NM	7.391		38,17	14.695,45	0,15%	0,00%	0,34	0,00	0,34	0,11%	0,01%
1039	20/12/2019	19/03/2020	BBSE3	BBSEGURIDADE ON N1	385	-385	21,73	5.997,48	5,25%	0,00%	4,87	0,00	4,87	0,04%	0,00%
1042	20/12/2019	19/03/2020	MRVE3	MRV ON NM	276		36,16	5.279,36	0,12%	0,00%	0,10	0,00	0,10	0,04%	0,00%
1043	20/12/2019	19/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	146		21,73	18.231,47	5,40%	0,00%	1,05	0,00	1,05	0,13%	0,01%
1047	20/12/2019	19/03/2020	MRVE3	MRV ON NM	839		18,24	44.505,60	0,15%	0,00%	0,30	0,00	0,30	0,17%	0,02%
1049	20/12/2019	19/03/2020	GBR4	GERDAU PN N1	2.440		36,16	24.299,52	0,08%	0,00%	0,21	0,00	0,21	0,11%	0,01%
1051	20/12/2019	19/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	672		87,49	15.048,28	0,12%	0,00%	0,28	0,00	0,28	0,06%	0,01%
1052	23/12/2019	23/03/2020	PCAR4	PACUCAR-CBDPN N1	172		31,73	7.869,04	0,30%	0,00%	0,19	0,00	0,19	0,09%	0,01%
1057	23/12/2019	23/03/2020	MULT3	MULTIPLAN ON N2	248		13,64	12.644,28	0,13%	0,00%	0,19	0,00	0,19	0,09%	0,01%
1014	23/12/2019	23/03/2020	CMIG4	CEMIG PN N1	927										



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



012/034

a de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

a da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

operações Doadoras

Cód. Operação	Dt.	Dt. Vencido	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Liq		
9020	23/12/2019	23/03/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON	N1	199	40,06	7.971,94	0,21%	0,00%	0,19	0,00	0,19	0,06%	0,01%
9025	23/12/2019	23/03/2020	MULT3	MULTIPLAN ON	N2	110	31,73	3.490,30	0,30%	0,00%	0,12	0,00	0,12	0,03%	0,00%
9124	23/12/2019	06/04/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	N2	349	18,86	6.582,14	0,15%	0,00%	0,11	0,00	0,11	0,05%	0,00%
9126	23/12/2019	23/03/2020	MULT3	MULTIPLAN ON	N2	255	31,73	8.091,15	0,30%	0,00%	0,28	0,00	0,28	0,06%	0,01%
9128	23/12/2019	04/02/2020	CIEL3	CIELO ON	NM	4	8,47	33,88	6,30%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,00%	0,00%
9130	23/12/2019	23/03/2020	RADL3	RAIADROGASILON	I	280	107,01	29.962,80	0,20%	0,00%	0,71	0,00	0,71	0,22%	0,02%
9131	23/12/2019	23/03/2020	MRV3	MRV ON	NM	728	21,09	15.353,52	5,35%	0,00%	9,52	0,00	9,52	0,11%	0,01%
9566	23/12/2019	10/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON	NM	6	47,95	287,70	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
9567	23/12/2019	17/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON	NM	22	47,95	1.054,90	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,01%	0,00%
9569	23/12/2019	18/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON	NM	14	47,95	671,30	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
9797	26/12/2019	25/03/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	N	1.627	116,29	189.203,83	0,77%	0,00%	11,51	0,00	11,51	1,36%	0,13%
9798	26/12/2019	25/03/2020	MRV3	MRV ON	NM	8	20,96	167,68	4,90%	0,00%	0,06	0,00	0,06	0,00%	0,00%
0190	26/12/2019	25/03/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	N	100	116,29	11.629,00	0,77%	0,00%	0,70	0,00	0,70	0,08%	0,01%
0192	26/12/2019	25/03/2020	RAIL3	RUMO S.A. ON	NM	141	25,82	3.640,62	0,12%	0,00%	0,03	0,00	0,03	0,03%	0,00%
0196	26/12/2019	25/03/2020	BRML3	BR MALLS PARON	N	432	18,00	7.776,00	0,15%	0,00%	0,09	0,00	0,09	0,06%	0,01%
0198	26/12/2019	25/03/2020	MULT3	MULTIPLAN ON	N2	425	31,85	13.536,25	0,30%	0,00%	0,32	0,00	0,32	0,10%	0,01%
0200	26/12/2019	25/03/2020	MULT3	MULTIPLAN ON	N2	31	31,85	987,35	0,30%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,01%	0,00%
0202	26/12/2019	25/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN	N	140	57,89	8.104,60	0,27%	0,00%	0,17	0,00	0,17	0,06%	0,01%
0836	27/12/2019	26/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA	N1	153	29,70	4.544,10	0,55%	0,00%	0,09	0,00	0,09	0,03%	0,00%
1753	27/12/2019	06/02/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	N	36.906	19,06	703.428,36	0,05%	0,00%	1,39	0,00	1,39	5,07%	0,47%
1754	27/12/2019	26/03/2020	ABEV3	AMBEV S/A ON	N	4.846	19,06	92.364,76	0,05%	0,00%	0,18	0,00	0,18	0,67%	0,06%
1755	27/12/2019	26/03/2020	VVAR3	VIAREJO ON	NM	2.485	11,88	29.521,80	0,17%	0,00%	0,19	0,00	0,19	0,21%	0,02%
1756	27/12/2019	06/02/2020	EGIE3	ENGIE BRASILON	N	137	50,70	6.945,90	0,24%	0,00%	0,06	0,00	0,06	0,05%	0,00%
1757	27/12/2019	26/03/2020	COGN3	COGNA ON	NM	1.578	11,53	18.194,34	0,11%	0,00%	0,07	0,00	0,07	0,13%	0,01%
1758	27/12/2019	06/02/2020	BRD3	PETROBRAS BRON	N	259	30,14	7.806,26	0,09%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,06%	0,01%
1759	27/12/2019	26/03/2020	LREN3	LOJAS RENNERNON	N	103	56,77	5.847,31	0,18%	0,00%	0,04	0,00	0,04	0,04%	0,00%
1760	27/12/2019	26/03/2020	BBAS3	BRASIL ON	NM	840	52,96	44.486,40	0,25%	0,00%	0,44	0,00	0,44	0,32%	0,03%
1761	27/12/2019	26/03/2020	MULT3	MULTIPLAN ON	N2	396	32,97	13.056,12	0,30%	0,00%	0,15	0,00	0,15	0,09%	0,01%
1762	27/12/2019	06/02/2020	BRML3	BR MALLS PARON	N	261	18,20	4.750,20	0,12%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,03%	0,00%
1763	27/12/2019	26/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA	N1	150	29,70	4.455,00	0,55%	0,00%	0,09	0,00	0,09	0,03%	0,00%
1764	27/12/2019	26/03/2020	AZUL4	AZUL PN	N2	1.141	57,30	65.379,30	0,21%	0,00%	0,54	0,00	0,54	0,47%	0,04%
1765	27/12/2019	26/03/2020	CSNA3	SID NACIONALON	N	253	14,56	3.683,68	0,19%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,03%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



013/034

ta de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

ta da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

IPRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL. MERC E FUTUROS

perações Doadoras

Cód. peração	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade em Liquidação	Quantidade	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Liq		
1766	27/12/2019	26/03/2020	EMBR3	ON NM	119	19,67	2.340,73	0,00%	0,08%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,02%	0,00%
1767	27/12/2019	26/03/2020	TIMP3	TIM PART S/AON NIV	2.124	15,51	32.943,24	0,00%	0,26%	0,00%	0,33	0,00	0,33	0,24%	0,02%
1768	27/12/2019	26/03/2020	ECOR3	ECORODOVIAS ON	546	16,37	8.938,02	0,00%	0,35%	0,00%	0,12	0,00	0,12	0,06%	0,01%
1769	27/12/2019	26/03/2020	CVCB3	CVC BRASIL ON NIV	159	43,47	6.911,73	0,00%	0,75%	0,00%	0,20	0,00	0,20	0,05%	0,00%
1770	27/12/2019	26/03/2020	UGPA3	ULTRAPAR ON NM	131	25,52	3.343,12	0,00%	0,16%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,02%	0,00%
1771	27/12/2019	06/02/2020	ECOR3	ECORODOVIAS ON	307	16,37	5.025,59	0,00%	0,25%	0,00%	0,04	0,00	0,04	0,04%	0,00%
1772	27/12/2019	06/02/2020	FLRY3	FLEURY ON NM	170	30,03	5.105,10	0,00%	0,11%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,04%	0,00%
1773	27/12/2019	06/02/2020	HYPER3	HYPERA ON NM	100	35,35	3.535,00	0,00%	0,14%	0,00%	0,01	0,00	0,01	0,03%	0,00%
1774	27/12/2019	06/02/2020	HYPER3	HYPERA ON NM	52	35,35	1.838,20	0,00%	0,11%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,04%	0,00%
1775	27/12/2019	06/02/2020	WEGE3	WEG ON NM	162	34,46	5.582,52	0,00%	0,15%	0,00%	0,05	0,00	0,05	0,06%	0,01%
1776	27/12/2019	06/02/2020	ELET6	ELETOBRAS PNB I	227	38,49	8.737,23	0,00%	6,00%	0,00%	0,85	0,00	0,85	0,03%	0,00%
1777	27/12/2019	26/03/2020	MRVE3	MRV ON NM	173	21,28	3.681,44	0,00%	0,05%	0,00%	0,06	0,00	0,06	0,22%	0,02%
1778	27/12/2019	06/02/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN I	813	37,21	30.251,73	0,00%	4,60%	0,00%	0,49	0,00	0,49	0,02%	0,00%
1779	27/12/2019	06/02/2020	MRVE3	MRV ON NM	130	21,28	2.766,40	0,00%	0,29%	0,00%	0,05	0,00	0,05	0,04%	0,00%
1780	27/12/2019	06/02/2020	MULT3	MULTIPLAN ON N2	152	32,97	5.011,44	0,00%	0,08%	0,00%	0,01	0,00	0,01	0,03%	0,00%
1781	27/12/2019	06/02/2020	B3SA3	B3 ON NM	101	46,62	4.708,62	0,00%	0,09%	0,00%	0,01	0,00	0,01	0,03%	0,00%
1782	27/12/2019	06/02/2020	RAIL3	RUMO S.A. ON NM	177	26,42	4.676,34	0,00%	0,18%	0,00%	0,03	0,00	0,03	0,04%	0,00%
1783	27/12/2019	06/02/2020	BBSE3	BBSEGURIDADEON	129	37,69	4.862,01	0,00%	0,15%	0,00%	0,03	0,00	0,03	0,04%	0,00%
1784	27/12/2019	06/02/2020	BFRS3	BRF SA ON NM	145	35,00	5.075,00	0,00%	0,11%	0,00%	0,01	0,00	0,01	0,03%	0,00%
1785	27/12/2019	06/02/2020	CCRO3	CCR SA ON NM	220	19,30	4.246,00	0,00%	0,18%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,03%	0,00%
1786	27/12/2019	06/02/2020	SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	103	40,37	4.158,11	0,00%	0,13%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,03%	0,00%
1787	27/12/2019	06/02/2020	CSNA3	SID NACIONALON	279	14,56	4.062,24	0,00%	0,11%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,03%	0,00%
1788	27/12/2019	06/02/2020	UGPA3	ULTRAPAR ON NM	177	25,52	4.517,04	0,00%	0,07%	0,00%	0,01	0,00	0,01	0,03%	0,00%
1789	27/12/2019	06/02/2020	EMBR3	EMBRAER ON NM	257	19,67	5.055,19	0,00%	0,10%	0,00%	0,02	0,00	0,02	0,04%	0,00%
1790	27/12/2019	06/02/2020	VVAR3	VIAREJO ON NM	453	11,88	5.381,64	0,00%	0,08%	0,00%	0,01	0,00	0,01	0,04%	0,00%
12439	30/12/2019	30/03/2020	BBDCA	BRADESCO PN N1	227	36,30	8.240,10	0,00%	0,05%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,06%	0,01%
12440	30/12/2019	30/03/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN I	20.066	37,31	748.662,46	0,00%	0,05%	0,00%	0,00	0,00	0,00	5,39%	0,50%
12441	30/12/2019	30/03/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN I	16.052	37,31	598.900,12	0,00%	0,05%	0,00%	0,00	0,00	0,00	4,31%	0,40%
12442	30/12/2019	30/03/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI	7.436	117,13	870.978,68	0,00%	0,90%	0,00%	0,00	0,00	0,00	6,27%	0,58%
12443	30/12/2019	30/03/2020	AZUL4	AZUL PN N2	1.224	57,16	69.963,84	0,00%	0,21%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,50%	0,05%
12444	30/12/2019	30/03/2020	CSNA3	SID NACIONALON	779	14,16	11.030,64	0,00%	0,14%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,08%	0,01%
12445	30/12/2019	30/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	201	19,86	3.991,86	0,00%	0,21%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,03%	0,00%



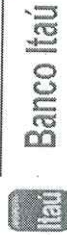
Relatório de Carteira Diária - Fechamento

a de Emissão: 30/01/2020 16:39:38

a da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



014/034

PRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

operações Doadoras

Cód. Operação	Dt. Operação	Dt. Vencido	Cód.	Papel	Quantidade em Liquidação	Quantidade	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Lq		
2446	30/12/2019	30/03/2020	YDUQ3	YDUQS PART ON	N	221	48.59	10.738,39	0,27%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,08%	0,01%
2447	30/12/2019	30/03/2020	ELET3	ELETROBRAS ON	N	109	37.56	4.094,04	8,50%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,03%	0,00%
2448	30/12/2019	30/03/2020	USIM5	USIMINAS PNA	N1	558	9.47	5.284,26	0,80%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,04%	0,00%
2449	30/12/2019	26/03/2020	MRVE3	MRV ON NM	NM	105	22.14	2.324,70	4,80%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,02%	0,00%
2450	30/12/2019	30/03/2020	BOVV11	IT NOW IBOV CI		111	117.13	13.001,43	0,90%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,09%	0,01%
2451	30/12/2019	30/03/2020	PCAR4	PACUCAR-CBDPN	N	1.844	88.12	162.493,28	0,15%	0,00%	0,00	0,00	0,00	1,17%	0,11%
2452	30/12/2019	30/03/2020	CIEL3	CIELO ON NM	NM	355	8.63	3.063,65	5,14%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,02%	0,00%
2453	30/12/2019	07/02/2020	KLBN11	KLabin S/A UNT	N2	438	18.47	8.089,86	0,10%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,06%	0,01%
2454	30/12/2019	07/02/2020	CIEL3	CIELO ON NM	NM	1.111	8.63	9.587,93	5,40%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,07%	0,01%
2455	30/12/2019	30/03/2020	GGBR4	GERDAU PN	N1	402	19.86	7.983,72	0,15%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,06%	0,01%
2758	30/12/2019	30/03/2020	ITUB4	ITAUUNIBANCOPN	N	144	37.31	5.372,64	0,08%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,04%	0,00%
2760	30/12/2019	30/03/2020	PETR3	PETROBRAS ON	N	111	32.41	3.597,51	0,14%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,03%	0,00%
2762	30/12/2019	30/03/2020	COGN3	COGNA ON	NM	1.318	10.87	14.326,66	0,12%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,10%	0,01%
2764	30/12/2019	30/03/2020	VIVT4	TELEF BRASILPN		124	58.67	7.275,08	0,22%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,05%	0,00%
2766	30/12/2019	30/03/2020	IRBR3	IRB BRASIL REON	N1	1.493	39.70	59.272,10	0,26%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,43%	0,04%
2768	30/12/2019	30/03/2020	BRKM5	BRASKEM PNA	N1	298	30.53	9.097,94	0,54%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,07%	0,01%
al								13.885.543,21			4.514,59	0,00	4.514,59	100,00%	9,26%
TOTAL BOLSA								13.885.543,21			4.514,59	0,00	4.514,59	100,00%	9,26%

TUROS / MERCADORIAS

BM&F - Bolsa de Mercadorias e Futuros

Ativo	Vencto.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
WIN	G20	ITAUCOR	1.913	0,00	0,00	0,00	115.952,00	44.363.235,20	100,00%	29,58%
TOTAL BOLSA				0,00	0,00	0,00		44.363.235,20	0,00%	29,58%
AL				0,00	0,00	0,00		44.363.235,20	100,00%	29,58%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ta de Emissão: 30/01/2020 16:59:39
 ta da Posição: 31/12/2019
 ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438



01/5/034

NDA FIXA

MERCADO NACIONAL

RA.FIN. TESOURO

TÍTULOS À VISTA

go	Aplicação	Emissor	Papel	MTM %AA	Tx Over	Taxa %AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Atual	Valor da Aplicação	Vlr Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
48	26/11/19	TESOURO	1528137	0.002300%	0.512944%	0.002473%	1h	01/07/00	01/03/20	8,0000	10.470.0646193	83.398,53	0,00	83.760,53	0,00	83.760,53	0,20%	0,06%
93	18/12/19	TESOURO	1528137	0.002300%	0.512944%	0.002525%	1h	01/07/00	01/03/20	79,0000	10.470.0646193	826.004,79	0,00	827.135,25	0,00	827.135,25	1,96%	0,55%
37	20/12/19	TESOURO	1528137	0.002300%	0.512944%	0.002348%	1h	01/07/00	01/03/20	26,0000	10.470.0646193	271.942,60	0,00	272.221,73	0,00	272.221,73	0,65%	0,18%
46	31/12/19	TESOURO	1528137	0.002300%	0.000000%	0.002692%	1h	01/07/00	01/03/20	19,0000	10.470.0646193	198.931,13	0,00	198.931,26	0,00	198.931,26	0,47%	0,13%
78	28/11/19	TESOURO	1583868	0.002300%	0.512944%	0.002172%	1h	01/07/00	01/09/20	133,0000	10.469.94510267	1.387.013,34	0,00	1.392.502,70	0,00	1.392.502,70	3,31%	0,93%
46	11/12/19	TESOURO	1583868	0.002300%	0.512944%	0.002147%	1h	01/07/00	01/09/20	133,0000	10.469.94510267	1.389.386,45	0,00	1.392.502,70	0,00	1.392.502,70	3,31%	0,93%
17	17/12/19	TESOURO	1583868	0.002300%	0.512944%	0.002190%	1h	01/07/00	01/09/20	10,0000	10.469.94510267	104.438,55	0,00	104.699,45	0,00	104.699,45	0,25%	0,07%
75	06/12/19	TESOURO	1639840	0.004400%	0.513194%	0.004231%	1h	01/07/00	01/03/21	170,0000	10.469.9451333	1.774.832,51	0,00	1.779.827,84	0,00	1.779.827,84	4,21%	1,19%
04	27/12/19	TESOURO	1639840	0.004400%	0.513194%	0.004434%	1h	01/07/00	01/03/21	346,0000	10.469.9451333	3.621.232,65	0,00	3.622.473,13	0,00	3.622.473,13	8,60%	2,42%
77	31/10/19	TESOURO	1678600	0.005500%	0.513225%	0.005335%	1h	01/07/00	01/09/21	86,0000	10.469.14823677	893.564,38	0,00	900.346,75	0,00	900.346,75	2,14%	0,60%
90	06/11/19	TESOURO	1678600	0.005500%	0.513225%	0.005327%	1h	01/07/00	01/09/21	205,0000	10.469.14823677	2.131.628,25	0,00	2.146.175,39	0,00	2.146.175,39	5,10%	1,43%
67	07/11/19	TESOURO	1678600	0.005500%	0.513225%	0.005338%	1h	01/07/00	01/03/23	1.381,0000	10.466.17693061	14.562.621,95	0,00	14.457.893,71	0,00	14.457.893,71	34,33%	9,44%
462	14/01/19	TESOURO	1836439	0.011900%	0.514087%	0.013017%	sele	13/01/17	01/03/23	225,0000	10.466.17693061	2.226.538,29	0,00	2.354.889,81	0,00	2.354.889,81	5,59%	1,57%
798	08/02/19	TESOURO	1836439	0.011900%	0.514087%	0.013012%	sele	13/01/17	01/03/23	12,0000	10.466.17693061	119.263,84	0,00	125.594,12	0,00	125.594,12	0,30%	0,08%
899	08/02/19	TESOURO	1836439	0.011900%	0.514087%	0.013012%	sele	13/01/17	01/03/23	138,0000	10.466.17693061	1.372.210,97	0,00	1.444.332,42	0,00	1.444.332,42	3,43%	0,96%
54	04/12/19	TESOURO	1836439	0.011900%	0.514087%	0.011827%	sele	13/01/17	01/03/23	126,0000	10.466.17693061	1.314.530,79	0,00	1.318.738,29	0,00	1.318.738,29	3,13%	0,88%
00	16/12/19	TESOURO	1836439	0.011900%	0.514087%	0.011819%	sele	13/01/17	01/03/23	203,0000	10.466.17693061	2.121.001,98	0,00	2.124.633,92	0,00	2.124.633,92	5,04%	1,42%
54	26/12/19	TESOURO	1836439	0.011900%	0.514087%	0.011925%	sele	14/07/17	01/09/23	236,0000	10.465.0466091	2.468.746,57	0,00	2.470.017,76	0,00	2.470.017,76	5,86%	1,65%
90	05/12/19	TESOURO	1891132	0.013200%	0.514242%	0.013020%	sele	14/07/17	01/09/23	22,0000	10.465.0466091	229.540,94	0,00	230.231,03	0,00	230.231,03	0,55%	0,15%
98	09/12/19	TESOURO	1891132	0.013200%	0.514242%	0.013021%	sele	14/07/17	01/09/23	281,0000	10.465.0466091	2.932.980,10	0,00	2.940.678,11	0,00	2.940.678,11	6,98%	1,96%
33	19/12/19	TESOURO	1891132	0.013200%	0.514242%	0.013024%	sele	14/07/17	01/09/23	156,0000	10.465.0466091	1.630.600,28	0,00	1.632.547,28	0,00	1.632.547,28	3,88%	1,09%
AL OPERAÇÕES À VISTA													0,00	41.820.133,18	0,00	41.820.133,18	99,30%	27,89%
AL LETRA FIN. TESOURO													0,00	41.820.133,18	0,00	41.820.133,18	99,30%	27,89%
AL MERCADO NACIONAL													0,00	41.820.133,18	0,00	41.820.133,18	99,30%	27,89%
AL													0,00	41.820.133,18	0,00	41.820.133,18	100,00%	27,89%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

016/034

ERAÇÕES COMPROMISSADAS

MERCADO NACIONAL

3º	Aquisição	Emissor	Papel	MTM %AA	Tx. Over	Taxa %AA	Index	Emissão	Vencido	Resgate	Quantidade	PU	Valor da Aplicação	Valor do Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
90	31/12/2019	TESOURO NTN-B		0,000000%	0,000000%	4,400000%	pre	15/07/00	15/05/23	02/01/20	80,0000	3,681,861,30488	294,548,90	294,599,23	294,548,90	0,00	294,548,90	0,70%	0,20%
TOTAL MERCADO NACIONAL																			
UL											80,0000		294,548,90	294,599,23	294,548,90	0,00	294,548,90	0,70%	0,20%

NTAS A PAGAR / RECEBER

crição

	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
prta de Ações [D+1]	(1.031.247,09)	(5,99%)	(0,69%)
to CETIP 08/01/2020	(1.924,93)	(0,01%)	(0,00%)
to SELIC 15/01/2020	(117,69)	(0,00%)	(0,00%)
pesa de AUDITORIA com pagamento 25/06/2020	(5.185,30)	(0,03%)	(0,00%)
pesa de Cartório - Atas/Livros Eletronicos com pagamento 31/12/2020	(207,07)	(0,00%)	(0,00%)
pesa de Taxa CBLC (CCBA)	(258,56)	(0,00%)	(0,00%)
pesas com Impresses em 24/01/20	(36,86)	(0,00%)	(0,00%)
rimento de despesa de Taxa Bimestral ANBID com vencimento 31/01/2020	338,19	0,00%	0,00%
d. a rec. s/ 1,179 de EGIE3 em 31/12/2049 - Emp.Ações ITAUCOR [CC]	1.290,90	0,01%	0,00%
d. a rec. s/ 12,663 de ITUB4 em 02/01/2020 - Emp.Ações ITAUCOR [CC]	189,93	0,00%	0,00%
d. a rec. s/ 339 de ITSA4 em 02/01/2020 - Emp.Ações ITAUCOR [CC]	6,78	0,00%	0,00%
dendo de 0,02 a rec. s/ 115,448 de ITUB4 em 02/01/2020	1.731,72	0,01%	0,00%
dendo de 0,02 a rec. s/ 121,199 de ITSA4 em 02/01/2020	2.423,98	0,01%	0,00%
dendo de 1,09 a rec. s/ 5,695 de EGIE3 em 31/12/2049	6,235,73	0,04%	0,00%
tr. de Ações a receber para o papel ABEV3 na ITAUCOR em 02/03/20	6.814,55	0,04%	0,00%
tr. de Ações a receber para o papel ABEV3 na ITAUCOR em 06/02/20	689,035,02	4,00%	0,46%
tr. de Ações a receber para o papel ABEV3 na ITAUCOR em 06/04/20	6,515,83	0,04%	0,00%
tr. de Ações a receber para o papel ABEV3 na ITAUCOR em 17/03/20	2.445,77	0,01%	0,00%
tr. de Ações a receber para o papel ABEV3 na ITAUCOR em 18/03/20	133,471,83	0,78%	0,09%
tr. de Ações a receber para o papel ABEV3 na ITAUCOR em 19/02/20	78,208,63	0,45%	0,05%
tr. de Ações a receber para o papel ABEV3 na ITAUCOR em 26/03/20	90,474,82	0,53%	0,06%
tr. de Ações a receber para o papel AZUL4 na ITAUCOR em 26/03/20	3,603,31	0,02%	0,00%
tr. de Ações a receber para o papel AZUL4 na ITAUCOR em 30/03/20	66,497,48	0,39%	0,04%
tr. de Ações a receber para o papel B3SA3 na ITAUCOR em 06/02/20	71,334,72	0,41%	0,05%
tr. de Ações a receber para o papel B3SA3 na ITAUCOR em 10/03/20	4,339,97	0,03%	0,00%
tr. de Ações a receber para o papel B3SA3 na ITAUCOR em 10/03/20	4,554,82	0,03%	0,00%
tr. de Ações a receber para o papel BBAS3 na ITAUCOR em 10/03/20	8,768,12	0,05%	0,01%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

1a de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

1a da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

017/034

NTAS A PAGAR / RECEBER

crição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
rr. de Ações a receber para o papel BBAS3 na ITAUCOR em 26/03/20	44.368,80	0,26%	0,03%
rr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 10/03/20	39.714,66	0,23%	0,03%
rr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 18/03/20	63.948,56	0,37%	0,04%
rr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 19/03/20	29.587,06	0,17%	0,02%
rr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 20/02/20	4.774,44	0,03%	0,00%
rr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 28/02/20	21.340,30	0,12%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 30/03/20	8.210,59	0,05%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BBSE3 na ITAUCOR em 02/03/20	11.121,50	0,06%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BBSE3 na ITAUCOR em 03/03/20	11.121,50	0,06%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BBSE3 na ITAUCOR em 06/02/20	4.863,30	0,03%	0,00%
rr. de Ações a receber para o papel BBSE3 na ITAUCOR em 10/03/20	33.967,70	0,20%	0,02%
rr. de Ações a receber para o papel BBSE3 na ITAUCOR em 19/03/20	14.514,50	0,08%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BBSE3 na ITAUCOR em 21/01/20	16.211,00	0,09%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BBSE3 na ITAUCOR em 28/02/20	32.308,90	0,19%	0,02%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 03/02/20	763.646,25	4,44%	0,51%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 09/03/20	21.622,50	0,13%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 10/02/20	1.015.908,75	5,90%	0,68%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 11/02/20	244.008,75	1,42%	0,16%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 12/02/20	334.683,75	1,94%	0,22%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 14/01/20	1.073.917,50	6,24%	0,72%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 15/01/20	198.787,50	1,16%	0,13%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 16/03/20	17.670,00	0,10%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 18/03/20	61.031,25	0,35%	0,04%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 25/03/20	200.763,75	1,17%	0,13%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 28/02/20	992.193,75	5,77%	0,66%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 30/01/20	366.303,75	2,13%	0,24%
rr. de Ações a receber para o papel BOVV11 na ITAUCOR em 30/03/20	877.338,75	5,10%	0,59%
rr. de Ações a receber para o papel BPAC11 na ITAUCOR em 18/03/20	19.641,54	0,11%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BRAP4 na ITAUCOR em 17/02/20	7.273,20	0,04%	0,00%
rr. de Ações a receber para o papel BRDT3 na ITAUCOR em 06/02/20	7.788,13	0,05%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BRFS3 na ITAUCOR em 06/02/20	5.104,00	0,03%	0,00%
rr. de Ações a receber para o papel BRFS3 na ITAUCOR em 19/02/20	7.392,00	0,04%	0,00%
rr. de Ações a receber para o papel BRFS3 na ITAUCOR em 28/01/20	27.737,60	0,16%	0,02%
rr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 10/02/20	8.447,55	0,05%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 10/03/20	28.238,10	0,16%	0,02%
rr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 17/03/20	15.581,70	0,09%	0,01%
rr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 18/03/20	4.925,25	0,03%	0,00%
rr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 19/02/20	12.566,85	0,07%	0,01%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

018/034

NTAS A PAGAR / RECEBER

scrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
pr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 20/01/20	8.059,50	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 20/02/20	7.104,30	0,04%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 26/03/20	9.044,55	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BRKM5 na ITAUCOR em 30/03/20	8.895,30	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 06/02/20	4.713,66	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 11/02/20	1.932,42	0,01%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 14/01/20	5.291,58	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 16/03/20	72.817,92	0,42%	0,05%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 17/02/20	28.480,62	0,17%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 17/03/20	4.406,64	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 20/02/20	10.131,66	0,06%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BRML3 na ITAUCOR em 25/03/20	7.801,92	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BTOW3 na ITAUCOR em 10/01/20	12.509,14	0,07%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BTOW3 na ITAUCOR em 18/03/20	19.989,48	0,12%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BTOW3 na ITAUCOR em 20/01/20	34.510,14	0,20%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel CCR03 na ITAUCOR em 02/03/20	20.953,92	0,12%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CCR03 na ITAUCOR em 06/02/20	4.175,60	0,02%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CCR03 na ITAUCOR em 10/03/20	4.289,48	0,02%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CCR03 na ITAUCOR em 17/02/20	15.753,40	0,09%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CCR03 na ITAUCOR em 19/02/20	3.796,00	0,02%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CCR03 na ITAUCOR em 30/01/20	2.068,82	0,01%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 02/03/20	13.392,00	0,08%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 04/02/20	35,48	0,00%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 07/02/20	9.299,07	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 09/01/20	6.980,58	0,04%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 09/03/20	2.117,61	0,01%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 10/03/20	5.532,57	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 11/03/20	17.443,08	0,10%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 12/03/20	31.186,62	0,18%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 16/03/20	8.662,95	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 17/03/20	10.663,38	0,06%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 19/03/20	8.144,01	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 21/01/20	1.054,62	0,01%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 22/01/20	1.322,46	0,01%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 27/01/20	5.825,52	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 27/02/20	3.222,45	0,02%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 28/02/20	5.842,26	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel CIEL3 na ITAUCOR em 30/03/20	2.971,35	0,02%	0,00%

IGEPREV
FI 317
198

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ata de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

ata da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

cliente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

019/034

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Inscrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
npr. de Ações a receber para o papel CMIG4 na ITAUCOR em 03/02/20	2.233,98	0,01%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel CMIG4 na ITAUCOR em 11/03/20	13.086,71	0,08%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CMIG4 na ITAUCOR em 23/03/20	12.783,33	0,07%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel COGN3 na ITAUCOR em 11/02/20	6.252,21	0,04%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel COGN3 na ITAUCOR em 12/02/20	1.337,31	0,01%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel COGN3 na ITAUCOR em 16/03/20	38.999,16	0,23%	0,03%
npr. de Ações a receber para o papel COGN3 na ITAUCOR em 18/03/20	67.071,24	0,39%	0,04%
npr. de Ações a receber para o papel COGN3 na ITAUCOR em 20/02/20	12.104,37	0,07%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel COGN3 na ITAUCOR em 30/03/20	18.036,54	0,10%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel COGN3 na ITAUCOR em 05/03/20	15.064,74	0,09%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSAN3 na ITAUCOR em 11/02/20	40.211,46	0,23%	0,03%
npr. de Ações a receber para o papel CSAN3 na ITAUCOR em 12/02/20	9.113,67	0,05%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSAN3 na ITAUCOR em 18/03/20	19.201,32	0,11%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSAN3 na ITAUCOR em 19/02/20	35.480,70	0,21%	0,02%
npr. de Ações a receber para o papel CSAN3 na ITAUCOR em 02/03/20	13.218,30	0,08%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 06/02/20	3.273,52	0,02%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 10/03/20	3.936,69	0,02%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 16/03/20	5.644,00	0,03%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 17/03/20	13.446,83	0,08%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 18/03/20	21.193,22	0,12%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 20/02/20	16.057,18	0,09%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 26/03/20	13.164,63	0,08%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 28/02/20	3.569,83	0,02%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel CSNA3 na ITAUCOR em 30/03/20	21.884,61	0,13%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CVCB3 na ITAUCOR em 03/03/20	10.991,69	0,06%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CVCB3 na ITAUCOR em 09/03/20	19.228,20	0,11%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CVCB3 na ITAUCOR em 26/03/20	46.471,80	0,27%	0,03%
npr. de Ações a receber para o papel CYRE3 na ITAUCOR em 10/02/20	6.964,20	0,04%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel CYRE3 na ITAUCOR em 11/03/20	8.253,82	0,05%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel CYRE3 na ITAUCOR em 17/03/20	76.303,30	0,44%	0,05%
npr. de Ações a receber para o papel ECOR3 na ITAUCOR em 06/02/20	15.260,66	0,09%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel ECOR3 na ITAUCOR em 26/03/20	5.004,10	0,03%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 06/02/20	8.899,80	0,05%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 12/03/20	6.959,60	0,04%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 16/03/20	6.248,40	0,04%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 17/02/20	7.315,20	0,04%	0,00%
npr. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 17/03/20	11.785,60	0,07%	0,01%
npr. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 17/03/20	6.096,00	0,04%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

a de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

a da Posição: 31/12/2019 Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17.5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



020/034

NTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ir. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 22/01/20	7.670,80	0,04%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 27/01/20	10.718,80	0,06%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 28/02/20	12.090,40	0,07%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel EGIE3 na ITAUCOR em 31/01/20	5.689,60	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel ELET3 na ITAUCOR em 05/03/20	7.597,80	0,04%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel ELET3 na ITAUCOR em 10/03/20	44.566,20	0,26%	0,03%
ir. de Ações a receber para o papel ELET3 na ITAUCOR em 16/03/20	14.515,20	0,08%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel ELET3 na ITAUCOR em 19/03/20	4.120,20	0,02%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel ELET3 na ITAUCOR em 28/02/20	84.747,60	0,49%	0,06%
ir. de Ações a receber para o papel ELET6 na ITAUCOR em 06/02/20	4.120,20	0,02%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel EMBR3 na ITAUCOR em 06/02/20	8.680,48	0,05%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel EMBR3 na ITAUCOR em 26/03/20	5.070,61	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel EMBR3 na ITAUCOR em 26/03/20	2.347,87	0,01%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel ENBR3 na ITAUCOR em 18/03/20	2.210,00	0,01%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel FLRY3 na ITAUCOR em 06/01/20	5.251,16	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel FLRY3 na ITAUCOR em 06/02/20	5.190,10	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel FLRY3 na ITAUCOR em 11/02/20	16.333,55	0,09%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 02/03/20	34.160,00	0,20%	0,02%
ir. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 10/03/20	28.640,00	0,17%	0,02%
ir. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 11/03/20	5.440,00	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 16/03/20	16.120,00	0,09%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 19/03/20	3.420,00	0,02%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 20/02/20	48.800,00	0,28%	0,03%
ir. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 30/03/20	4.560,00	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel GOLL4 na ITAUCOR em 20/01/20	12.060,00	0,07%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel HYPE3 na ITAUCOR em 06/02/20	33.083,20	0,19%	0,02%
ir. de Ações a receber para o papel IRBR3 na ITAUCOR em 02/03/20	5.424,88	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel IRBR3 na ITAUCOR em 10/03/20	23.019,45	0,13%	0,02%
ir. de Ações a receber para o papel IRBR3 na ITAUCOR em 12/03/20	180.416,40	1,05%	0,12%
ir. de Ações a receber para o papel IRBR3 na ITAUCOR em 14/01/20	29.290,40	0,17%	0,02%
ir. de Ações a receber para o papel IRBR3 na ITAUCOR em 17/03/20	64.033,80	0,37%	0,04%
ir. de Ações a receber para o papel IRBR3 na ITAUCOR em 28/02/20	8.569,00	0,05%	0,01%
ir. de Ações a receber para o papel ITSA4 na ITAUCOR em 30/03/20	5.024,55	0,03%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 04/02/20	58.152,35	0,34%	0,04%
ir. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 06/02/20	2.606,65	0,02%	0,00%
ir. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 06/02/20	272.833,40	1,59%	0,18%
ir. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 08/01/20	30.162,30	0,18%	0,02%
ir. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 08/01/20	32.202,80	0,19%	0,02%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

Data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

Identificador: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



021/034

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
pr. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 09/03/20	138.086,20	0,80%	0,09%
pr. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 12/03/20	4.452,00	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 20/01/20	7.382,90	0,04%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 21/01/20	5.119,80	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel ITUB4 na ITAUCOR em 30/03/20	1.345.320,20	7,82%	0,90%
pr. de Ações a receber para o papel JBSS3 na ITAUCOR em 09/03/20	220.099,80	1,28%	0,15%
pr. de Ações a receber para o papel JBSS3 na ITAUCOR em 10/03/20	9.262,20	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel KLBNI1 na ITAUCOR em 06/02/20	9.260,23	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel KLBNI1 na ITAUCOR em 07/02/20	8.063,58	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel KLBNI1 na ITAUCOR em 09/03/20	30.358,09	0,18%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel KLBNI1 na ITAUCOR em 11/03/20	22.607,48	0,13%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel KLBNI1 na ITAUCOR em 18/03/20	23.288,65	0,14%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel KLBNI1 na ITAUCOR em 19/03/20	52.947,16	0,31%	0,04%
pr. de Ações a receber para o papel KLBNI1 na ITAUCOR em 28/02/20	5.872,79	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel LAME4 na ITAUCOR em 18/03/20	8.498,48	0,05%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel LREN3 na ITAUCOR em 16/03/20	25.397,88	0,15%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel LREN3 na ITAUCOR em 26/03/20	5.787,57	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRFG3 na ITAUCOR em 18/03/20	3.426,24	0,02%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 06/02/20	2.801,50	0,02%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 07/04/20	2.564,45	0,01%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 16/03/20	5.710,75	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 17/03/20	5.365,95	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 19/03/20	24.028,25	0,14%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 23/03/20	15.688,40	0,09%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 25/03/20	172,40	0,00%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 26/03/20	5.990,90	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MRVE3 na ITAUCOR em 27/02/20	4.417,75	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MULT3 na ITAUCOR em 06/02/20	5.031,20	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel MULT3 na ITAUCOR em 14/01/20	34.622,60	0,20%	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel MULT3 na ITAUCOR em 23/03/20	20.290,30	0,12%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel MULT3 na ITAUCOR em 25/03/20	15.093,60	0,09%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel MULT3 na ITAUCOR em 26/03/20	13.107,60	0,08%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel NTCOS na ITAUCOR em 11/03/20	4.988,43	0,03%	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel NTCOS na ITAUCOR em 12/03/20	170.534,70	0,99%	0,11%
pr. de Ações a receber para o papel PCAR4 na ITAUCOR em 18/03/20	151.985,10	0,88%	0,10%
pr. de Ações a receber para o papel PCAR4 na ITAUCOR em 23/03/20	15.075,80	0,09%	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel PETR3 na ITAUCOR em 30/03/20	161.626,60	0,94%	0,11%
pr. de Ações a receber para o papel PETR3 na ITAUCOR em 10/03/20	64.000,00	0,37%	0,04%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

à de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

à de Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

nte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

022/034

ITAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
: de Ações a receber para o papel PETR3 na ITAUCOR em 30/03/20	3.552,00	0,02%	0,00%
: de Ações a receber para o papel PETR4 na ITAUCOR em 10/03/20	172.931,40	1,00%	0,12%
: de Ações a receber para o papel PETR4 na ITAUCOR em 17/03/20	4.044,12	0,02%	0,00%
: de Ações a receber para o papel RADL3 na ITAUCOR em 23/03/20	31.259,20	0,18%	0,02%
: de Ações a receber para o papel RAIL3 na ITAUCOR em 06/02/20	4.619,70	0,03%	0,00%
: de Ações a receber para o papel RAIL3 na ITAUCOR em 25/03/20	3.680,10	0,02%	0,00%
: de Ações a receber para o papel RENT3 na ITAUCOR em 10/03/20	6.210,71	0,04%	0,00%
: de Ações a receber para o papel RENT3 na ITAUCOR em 17/03/20	21.903,42	0,13%	0,01%
: de Ações a receber para o papel RENT3 na ITAUCOR em 18/03/20	14.317,82	0,08%	0,01%
: de Ações a receber para o papel SANB11 na ITAUCOR em 10/02/20	27.037,92	0,16%	0,02%
: de Ações a receber para o papel SANB11 na ITAUCOR em 11/02/20	9.904,00	0,06%	0,01%
: de Ações a receber para o papel SANB11 na ITAUCOR em 12/02/20	9.804,96	0,06%	0,01%
: de Ações a receber para o papel SANB11 na ITAUCOR em 17/03/20	16.490,16	0,10%	0,01%
: de Ações a receber para o papel SANB11 na ITAUCOR em 19/02/20	8.269,84	0,05%	0,01%
: de Ações a receber para o papel SANB11 na ITAUCOR em 27/01/20	35.109,68	0,20%	0,02%
: de Ações a receber para o papel SBSP3 na ITAUCOR em 17/03/20	24.284,56	0,14%	0,02%
: de Ações a receber para o papel SUZB3 na ITAUCOR em 02/03/20	5.039,36	0,03%	0,00%
: de Ações a receber para o papel SUZB3 na ITAUCOR em 06/02/20	4.087,04	0,02%	0,00%
: de Ações a receber para o papel SUZB3 na ITAUCOR em 09/03/20	23.887,36	0,14%	0,02%
: de Ações a receber para o papel SUZB3 na ITAUCOR em 10/03/20	56.305,92	0,33%	0,04%
: de Ações a receber para o papel SUZB3 na ITAUCOR em 17/03/20	29.482,24	0,17%	0,02%
: de Ações a receber para o papel SUZB3 na ITAUCOR em 18/03/20	71.543,04	0,42%	0,05%
: de Ações a receber para o papel TIMP3 na ITAUCOR em 26/03/20	7.896,32	0,05%	0,01%
: de Ações a receber para o papel UGPA3 na ITAUCOR em 06/02/20	33.283,08	0,19%	0,02%
: de Ações a receber para o papel UGPA3 na ITAUCOR em 17/02/20	4.509,96	0,03%	0,00%
: de Ações a receber para o papel UGPA3 na ITAUCOR em 19/03/20	10.192,00	0,06%	0,01%
: de Ações a receber para o papel UGPA3 na ITAUCOR em 26/03/20	21.097,44	0,12%	0,01%
: de Ações a receber para o papel UGPA3 na ITAUCOR em 26/03/20	3.337,88	0,02%	0,00%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 05/02/20	7.646,04	0,04%	0,01%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 05/03/20	1.787,88	0,01%	0,00%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 10/02/20	3.499,68	0,02%	0,00%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 10/03/20	16.880,25	0,10%	0,01%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 12/03/20	1.321,89	0,01%	0,00%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 13/01/20	6.191,01	0,04%	0,00%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 16/03/20	10.537,08	0,06%	0,01%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 21/01/20	3.043,20	0,02%	0,00%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 28/02/20	12.201,33	0,07%	0,01%
: de Ações a receber para o papel USIM5 na ITAUCOR em 30/03/20	5.306,58	0,03%	0,00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ta de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

ta da Posição: 31/12/2019

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438



Banco Itaú

023/034

NTAS A PAGAR / RECEBER

crição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
x. de Ações a receber para o papel VALE3 na ITAUCOR em 16/03/20	42.160,30	0,25%	0,03%
x. de Ações a receber para o papel VALE3 na ITAUCOR em 19/03/20	393.940,30	2,29%	0,26%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 03/03/20	30.961,32	0,18%	0,02%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 05/03/20	9.276,80	0,05%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 06/02/20	5.855,98	0,03%	0,00%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 07/01/20	10.900,24	0,06%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 10/03/20	8.697,00	0,05%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 11/02/20	48.587,24	0,28%	0,03%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 12/03/20	8.986,90	0,05%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 16/03/20	17.915,82	0,10%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 17/03/20	29.801,72	0,17%	0,02%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 18/03/20	90.970,62	0,53%	0,06%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 19/03/20	7.363,46	0,04%	0,00%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 20/02/20	6.261,84	0,04%	0,00%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 22/01/20	14.263,08	0,08%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 25/03/20	8.117,20	0,05%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VIVT4 na ITAUCOR em 30/03/20	7.189,52	0,04%	0,00%
x. de Ações a receber para o papel VVAR3 na ITAUCOR em 06/02/20	5.060,01	0,03%	0,00%
x. de Ações a receber para o papel VVAR3 na ITAUCOR em 10/03/20	13.225,28	0,08%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel VVAR3 na ITAUCOR em 16/03/20	40.055,62	0,23%	0,03%
x. de Ações a receber para o papel VVAR3 na ITAUCOR em 26/03/20	27.757,45	0,16%	0,02%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 06/02/20	5.614,92	0,03%	0,00%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 10/02/20	10.051,40	0,06%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 11/02/20	9.323,54	0,05%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 11/03/20	19.132,32	0,11%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 16/03/20	12.477,60	0,07%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 17/03/20	26.064,32	0,15%	0,02%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 18/03/20	80.723,14	0,47%	0,05%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 19/02/20	5.961,52	0,03%	0,00%
x. de Ações a receber para o papel WEGE3 na ITAUCOR em 22/01/20	7.555,88	0,04%	0,01%
x. de Ações a receber para o papel YDUQ3 na ITAUCOR em 30/03/20	10.497,50	0,06%	0,01%
mo de Juros s/ cap. de 0,01 a rec. s/ 305 de ITSA4 em 30/04/2020 - Emp.Ação	(1,81)	(0,00%)	(0,00%)
mo de Juros s/ cap. de 0,04 a rec. s/ 812 de WEGE3 em 11/03/2020 - Emp.Ação	(53,19)	(0,00%)	(0,00%)
mo de Juros s/ cap. de 0,04 a rec. s/ 9,092 de ITUB4 em 30/04/2020 - Emp.Ação	(341,49)	(0,00%)	(0,00%)
mo de Juros s/ cap. de 0,10 a rec. s/ 352 de RENT3 em 14/02/2020 - Emp.Ação	(35,10)	(0,00%)	(0,00%)
mo de Juros s/ cap. de 0,13 a rec. s/ 248 de MULT3 em 29/05/2020 - Emp.Ação	(33,27)	(0,00%)	(0,00%)
mo de Juros s/ cap. de 0,16 a rec. s/ 1,430 de TIMP3 em 31/12/2049 - Emp.Ação	(223,75)	(0,00%)	(0,00%)
mo de Juros s/ cap. de 0,16 a rec. s/ 1,562 de RADL3 em 31/12/2049 - Emp.Ação	(246,38)	(0,00%)	(0,00%)



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

Identificador: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

024/034

INTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
orno de Juros s/ cap. de 0.20 a rec. s/ 5.369 de PETR4 em 07/02/2020 - Emp.Aç	(1.073.80)	(0.01%)	(0.00%)
orno de Juros s/ cap. de 0.26 a rec. s/ 399 de HYPE3 em 07/01/2020 - Emp.Aç	(101.89)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ cap. de 0.30 a rec. s/ 1.046 de HYPE3 em 07/01/2020 - Emp.Aç	(318.23)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ cap. de 0.59 a rec. s/ 486 de VIVT4 em 31/12/2049 - Emp.Aç	(287.39)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ cap. de 1.41 a rec. s/ 1.685 de VALES em 31/12/2049 - Emp.Aç	(2.383.20)	(0.01%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.04 a rec. s/ 120 de ITUB4 em 30/04/20	(4.50)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.08 a rec. s/ 103 de LREN3 em 31/12/49	(7.95)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.10 a rec. s/ 728 de RENT3 em 14/02/20	(72.61)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.13 a rec. s/ 462 de MULT3 em 29/05/20	(61.98)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.13 a rec. s/ 720 de NATU3 em 26/02/20	(92.04)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.16 a rec. s/ 129 de RADL3 em 31/12/49	(20.34)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.20 a rec. s/ 5.369 de PETR4 em 07/02/20	(1.073.80)	(0.01%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.30 a rec. s/ 152 de HYPE3 em 07/01/20	(46.24)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.35 a rec. s/ 96 de VIVT4 em 31/12/49	(33.42)	(0.00%)	(0.00%)
orno de Juros s/ capital de 0.42 a rec. s/ 159 de CVCB3 em 08/01/20	(66.36)	(0.00%)	(0.00%)
ra Bolsa BM&F [ITAUCOR]	(397.013.10)	(2.31%)	(0.26%)
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 02/03/20	0.53	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 06/02/20	1.39	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 06/04/20	0.11	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.15	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 18/03/20	4.29	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 19/02/20	7.29	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.18	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [ABEV3] na ITAUCOR em 30/01/20	0.45	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [B3SA3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.54	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [B3SA3] na ITAUCOR em 10/03/20	0.01	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBAS3] na ITAUCOR em 10/03/20	0.45	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBAS3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.34	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBDC4] na ITAUCOR em 10/03/20	0.44	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBDC4] na ITAUCOR em 18/03/20	3.47	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBDC4] na ITAUCOR em 19/03/20	0.94	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBDC4] na ITAUCOR em 20/02/20	0.40	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 28/02/20	0.28	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 02/03/20	0.93	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 03/03/20	1.14	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 06/02/20	1.06	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 10/03/20	0.03	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 10/03/20	2.26	0.00%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ta de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

ta da Posição: 31/12/2019

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438



Banco Itaú

025/034

INTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 19/03/20	0.34	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 21/01/20	0.81	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BBSE3] na ITAUCOR em 28/02/20	2.55	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 03/02/20	579.97	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 09/03/20	7.56	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 10/02/20	936.48	0.01%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 11/02/20	188.33	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 12/02/20	247.75	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 14/01/20	526.85	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 15/01/20	96.48	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 16/03/20	3.53	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 18/03/20	8.69	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 25/03/20	12.21	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BOVV11] na ITAUCOR em 28/02/20	470.42	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BPAC11] na ITAUCOR em 30/01/20	232.39	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRAP4] na ITAUCOR em 17/02/20	0.45	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRDT3] na ITAUCOR em 06/02/20	1.96	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.02	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.03	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 19/02/20	0.84	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 28/01/20	4.38	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 10/02/20	2.63	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 10/03/20	1.66	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 17/03/20	1.06	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 18/03/20	0.28	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 19/02/20	2.93	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 20/01/20	1.30	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 20/02/20	1.56	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.18	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.02	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 11/02/20	0.18	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 14/01/20	0.83	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 16/03/20	1.95	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 17/02/20	2.12	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.13	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 20/02/20	0.74	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BRFS3] na ITAUCOR em 25/03/20	0.09	0.00%	0.00%
ra de Empr. de Ações Doadora do papel [BTOW3] na ITAUCOR em 10/01/20	5.63	0.00%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

Data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - RS 17,5438

Identificador: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

026/034

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [BTOW3] na ITAUCOR em 18/03/20	1.04	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [BTOW3] na ITAUCOR em 20/01/20	9.55	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CCRO3] na ITAUCOR em 02/03/20	1.90	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CCRO3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.01	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CCRO3] na ITAUCOR em 10/03/20	0.20	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CCRO3] na ITAUCOR em 17/02/20	2.75	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CCRO3] na ITAUCOR em 19/02/20	0.67	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 30/01/20	0.40	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 04/02/20	59.65	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 09/01/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 09/03/20	3.40	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 10/03/20	6.24	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 11/03/20	13.56	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 12/03/20	34.92	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 16/03/20	58.56	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 17/03/20	14.50	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 19/03/20	13.61	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 21/01/20	6.97	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 22/01/20	3.11	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 27/02/20	3.56	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CIEL3] na ITAUCOR em 28/02/20	3.91	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CMIG4] na ITAUCOR em 03/02/20	2.12	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CMIG4] na ITAUCOR em 11/03/20	29.27	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CMIG4] na ITAUCOR em 23/03/20	0.31	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [COGN3] na ITAUCOR em 12/02/20	0.63	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [COGN3] na ITAUCOR em 16/03/20	0.19	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [COGN3] na ITAUCOR em 18/03/20	0.68	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [COGN3] na ITAUCOR em 20/02/20	0.04	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [COGN3] na ITAUCOR em 26/03/20	1.71	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSAN3] na ITAUCOR em 05/03/20	0.84	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSAN3] na ITAUCOR em 11/02/20	0.07	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSAN3] na ITAUCOR em 12/02/20	5.25	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSAN3] na ITAUCOR em 18/03/20	1.21	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSAN3] na ITAUCOR em 19/02/20	2.50	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 02/03/20	1.39	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 02/03/20	2.29	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 02/03/20	0.52	0.00%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

Data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - RS 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

027/034

CONTAS A PAGAR / RECEBER

scrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 10/03/20	1.12	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 16/03/20	1.58	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 17/03/20	1.48	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 18/03/20	0.92	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 20/02/20	1.79	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CSNA3] na ITAUCOR em 28/02/20	3.38	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CVCB3] na ITAUCOR em 03/03/20	23.70	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CVCB3] na ITAUCOR em 09/03/20	2.48	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CVCB3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.20	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CYRE3] na ITAUCOR em 10/02/20	0.34	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CYRE3] na ITAUCOR em 11/03/20	3.41	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [CYRE3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.90	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ECOR3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.04	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ECOR3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.12	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EGIE3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.06	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EGIE3] na ITAUCOR em 12/03/20	0.46	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EGIE3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.43	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EGIE3] na ITAUCOR em 22/01/20	1.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EGIE3] na ITAUCOR em 27/01/20	0.47	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EGIE3] na ITAUCOR em 28/02/20	1.57	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EGIE3] na ITAUCOR em 31/01/20	2.09	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ELET3] na ITAUCOR em 05/03/20	2.48	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ELET3] na ITAUCOR em 10/03/20	0.35	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ELET3] na ITAUCOR em 16/03/20	7.30	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ELET3] na ITAUCOR em 19/03/20	31.57	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ELET3] na ITAUCOR em 28/02/20	10.48	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ELET3] na ITAUCOR em 28/02/20	4.22	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ELET3] na ITAUCOR em 06/02/20	176.95	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [EMBR3] na ITAUCOR em 18/03/20	0.05	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ENBR3] na ITAUCOR em 06/01/20	0.01	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [FLRY3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.03	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [FLRY3] na ITAUCOR em 11/02/20	1.12	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 02/03/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 10/03/20	6.32	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 10/03/20	4.41	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 10/03/20	1.64	0.00%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



028/034

Data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

Data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - RS 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

NTAS A PAGAR / RECEBER

scrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 11/03/20	0.28	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 16/03/20	0.74	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 18/03/20	0.10	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 19/03/20	1.05	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 20/02/20	0.34	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [GOL4] na ITAUCOR em 20/01/20	58.46	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [HYPE3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [IRBR3] na ITAUCOR em 02/03/20	2.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [IRBR3] na ITAUCOR em 10/03/20	13.38	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [IRBR3] na ITAUCOR em 12/03/20	2.20	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [IRBR3] na ITAUCOR em 14/01/20	8.11	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [IRBR3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.31	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [IRBR3] na ITAUCOR em 28/02/20	0.63	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITSA4] na ITAUCOR em 17/02/20	0.52	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITUB4] na ITAUCOR em 04/02/20	29.56	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITUB4] na ITAUCOR em 06/02/20	0.06	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITUB4] na ITAUCOR em 08/01/20	7.84	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITUB4] na ITAUCOR em 09/03/20	7.76	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITUB4] na ITAUCOR em 12/03/20	0.15	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITUB4] na ITAUCOR em 20/01/20	0.61	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [ITUB4] na ITAUCOR em 21/01/20	0.59	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [JBSS3] na ITAUCOR em 09/03/20	8.67	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [JBSS3] na ITAUCOR em 10/03/20	0.28	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [KLBNI1] na ITAUCOR em 06/02/20	1.79	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [KLBNI1] na ITAUCOR em 09/03/20	1.71	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [KLBNI1] na ITAUCOR em 11/03/20	1.44	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [KLBNI1] na ITAUCOR em 18/03/20	0.58	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [KLBNI1] na ITAUCOR em 19/03/20	1.11	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [KLBNI1] na ITAUCOR em 28/02/20	0.74	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [LAME4] na ITAUCOR em 18/03/20	0.41	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [LREN3] na ITAUCOR em 16/03/20	1.35	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [LREN3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.04	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [MRFG3] na ITAUCOR em 18/03/20	4.41	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.49	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 07/04/20	4.73	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 16/03/20	10.54	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 17/03/20	6.95	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 19/03/20	20.09	0.00%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

data de Emissão: 30/01/2020 16:59:39

data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

029/034

INTAS A PAGAR / RECEBER

scrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 23/03/20	9.52	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 25/03/20	0.06	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.85	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MRVE3] na ITAUCOR em 27/02/20	21.69	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MULT3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.05	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MULT3] na ITAUCOR em 14/01/20	15.25	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MULT3] na ITAUCOR em 23/03/20	0.68	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MULT3] na ITAUCOR em 25/03/20	0.34	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MULT3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.15	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [NTCO3] na ITAUCOR em 11/03/20	3.62	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [NTCO3] na ITAUCOR em 12/03/20	113.63	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [PCAR4] na ITAUCOR em 18/03/20	3.58	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [PCAR4] na ITAUCOR em 23/03/20	0.21	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [PETR3] na ITAUCOR em 10/03/20	2.81	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [PETR4] na ITAUCOR em 10/03/20	26.51	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [PETR4] na ITAUCOR em 17/03/20	0.12	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [RADL3] na ITAUCOR em 23/03/20	0.71	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [RAIL3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.01	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [RAIL3] na ITAUCOR em 25/03/20	0.03	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [RENT3] na ITAUCOR em 10/03/20	0.24	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [RENT3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.64	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [RENT3] na ITAUCOR em 18/03/20	0.43	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SANB1] na ITAUCOR em 10/02/20	11.15	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SANB1] na ITAUCOR em 11/02/20	3.69	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SANB1] na ITAUCOR em 12/02/20	3.47	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SANB1] na ITAUCOR em 17/03/20	0.53	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SANB1] na ITAUCOR em 19/02/20	1.87	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SANB1] na ITAUCOR em 27/01/20	12.24	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SBSP3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.44	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SUZB3] na ITAUCOR em 02/03/20	0.65	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SUZB3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.02	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SUZB3] na ITAUCOR em 09/03/20	2.72	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SUZB3] na ITAUCOR em 10/03/20	4.70	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SUZB3] na ITAUCOR em 17/03/20	1.05	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SUZB3] na ITAUCOR em 18/03/20	2.82	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SUZB3] na ITAUCOR em 23/03/20	0.19	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [TIMP3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.33	0.00%	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [UGPA3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.01	0.00%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

030/034

NTAS A PAGAR / RECEBER

scrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [UGPA3] na ITAUCOR em 17/02/20	1.52	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [UGPA3] na ITAUCOR em 19/03/20	0.41	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [UGPA3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 05/02/20	5.99	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 05/03/20	0.36	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 10/02/20	3.11	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 10/03/20	2.76	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 12/03/20	0.18	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 13/01/20	21.53	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 16/03/20	0.84	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 21/01/20	0.70	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [USIM5] na ITAUCOR em 28/02/20	2.57	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VALE3] na ITAUCOR em 16/03/20	0.94	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VALE3] na ITAUCOR em 19/03/20	3.16	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 03/03/20	7.18	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 05/03/20	1.70	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 06/02/20	2.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 07/01/20	10.63	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 10/03/20	1.03	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 11/02/20	18.15	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 12/03/20	0.92	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 16/03/20	1.37	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 17/03/20	1.81	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 18/03/20	4.43	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 19/03/20	0.28	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 20/02/20	1.70	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 22/01/20	3.74	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VIVT4] na ITAUCOR em 25/03/20	0.17	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VVAR3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VVAR3] na ITAUCOR em 10/03/20	1.06	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VVAR3] na ITAUCOR em 16/03/20	1.85	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [VVAR3] na ITAUCOR em 26/03/20	0.19	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.02	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 10/02/20	1.39	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 11/02/20	1.32	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 11/03/20	0.91	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 16/03/20	0.38	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 17/03/20	0.66	0.00%	0.00%

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

Data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

Fonte: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



Banco Itaú

031/034

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 18/03/20	2.21	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 19/02/20	0.89	0.00%	0.00%
ura de Empr. de Ações Doadora do papel [WEGE3] na ITAUCOR em 22/01/20	1.72	0.00%	0.00%
ura de empréstimo doador de ações, papel [BRKM5], na [ITAUCOR]	1.95	0.00%	0.00%
ura de empréstimo doador de ações, papel [COGN3], na [ITAUCOR]	3.18	0.00%	0.00%
ura de empréstimo doador de ações, papel [IRBR3], na [ITAUCOR]	17.40	0.00%	0.00%
ura de empréstimo doador de ações, papel [ITUB4], na [ITAUCOR]	0.63	0.00%	0.00%
ura de empréstimo doador de ações, papel [PETR3], na [ITAUCOR]	0.56	0.00%	0.00%
ura de empréstimo doador de ações, papel [VIVT4], na [ITAUCOR]	8.07	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 1.127 de LAME4 em 03/02/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	189.32	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 1.179 de EGIE3 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	511.49	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 1.198 de HYPE3 em 07/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	364.47	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 1.205 de RENT3 em 14/02/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	120.16	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 1.447 de LREN3 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	112.35	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 1.485 de HYPE3 em 07/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	379.20	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 1.920 de CVCB3 em 08/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	801.34	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 16.349 de PETR4 em 07/02/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	3.269.80	0.02%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 190 de BRAP4 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	151.86	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 2.038 de CMIG4 em 30/06/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	279.51	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 2.038 de CMIG4 em 30/12/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	279.51	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 2.264 de RADL3 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	357.10	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 2.395 de VIVT4 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	1.024.13	0.01%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 2.438 de BBDC4 em 02/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	46.21	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 2.700 de MULT3 em 29/05/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	362.21	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 228 de BBDC3 em 02/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	3.93	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 233 de HYPE3 em 07/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	59.55	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 25.659 de ITUB4 em 30/04/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	963.69	0.01%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 287 de PETR3 em 07/02/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	57.40	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 3.775 de TIMP3 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	590.65	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 3.887 de VIVT4 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	1.353.45	0.01%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 303 de MGLU3 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	22.29	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 4.011 de NATU3 em 26/02/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	512.75	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 4.144 de VIVT4 em 31/12/2049 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	2.450.47	0.01%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 4.942 de WEGE3 em 11/03/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	188.91	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 428 de HYPE3 em 07/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	11.28	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 428 de HYPE3 em 07/01/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	97.73	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 490 de ITSA4 em 30/04/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	2.91	0.00%	0.00%
os s/ cap. a rec. s/ 5.864 de PETR4 em 07/02/2020 - Emp. Ações ITAUCOR [CC]	2.462.88	0.01%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ta de Emissão: 30/01/2020 16:39:39

ta da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



032/034

INTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ss s/ cap. a rec. s/ 555 de LREN3 em 31/12/2049 - Emp.Ações ITAUCOR [CC/]	42.87	0.00%	0.00%
ss s/ cap. a rec. s/ 6,755 de WEGE3 em 11/03/2020 - Emp.Ações ITAUCOR [CC/]	276.07	0.00%	0.00%
ss s/ cap. a rec. s/ 8,277 de KLBNI1 em 20/02/2020 - Emp.Ações ITAUCOR [CC/]	1.570.49	0.01%	0.00%
ss s/ cap. a rec. s/ 860 de VIVT4 em 31/12/2049 - Emp.Ações PACTUAL [CC/]	367.76	0.00%	0.00%
ss s/ cap. a rec. s/ 9,867 de VALE3 em 31/12/2049 - Emp.Ações ITAUCOR [CC/]	13.955.52	0.08%	0.01%
ss s/ capital de 0.01 a rec. s/ 121,048 de ITSA4 em 30/04/20	720.23	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.01 a rec. s/ 305 de ITSA4 em 30/04/20	1.81	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.02 a rec. s/ 102,307 de BBDC4 em 02/01/20	1.941.25	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.02 a rec. s/ 30,101 de BBDC3 em 02/01/20	519.23	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.03 a rec. s/ 7,272 de HYPE3 em 07/01/20	191.76	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.04 a rec. s/ 102,572 de ITUB4 em 30/04/20	3.852.60	0.02%	0.00%
ss s/ capital de 0.04 a rec. s/ 14,957 de WEGE3 em 11/03/20	571.88	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.04 a rec. s/ 812 de WEGE3 em 11/03/20	33.19	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.04 a rec. s/ 9,092 de ITUB4 em 30/04/20	341.49	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.04 a rec. s/ 9,944 de WEGE3 em 11/03/20	406.53	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.07 a rec. s/ 12,197 de MGLU3 em 31/12/49	897.77	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.08 a rec. s/ 15,307 de LREN3 em 31/12/49	1.188.58	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.08 a rec. s/ 17,654 de LREN3 em 31/12/49	1.387.39	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.09 a rec. s/ 20,702 de LREN3 em 31/12/49	1.599.80	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.10 a rec. s/ 15,378 de LREN3 em 31/12/49	1.429.30	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.10 a rec. s/ 14,728 de RENT3 em 14/02/20	1.469.00	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.10 a rec. s/ 352 de RENT3 em 14/02/20	35.10	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.13 a rec. s/ 248 de MULT3 em 29/05/20	33.27	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.13 a rec. s/ 3,821 de MULT3 em 29/05/20	512.66	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.14 a rec. s/ 5,067 de NATU3 em 26/02/20	647.79	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.14 a rec. s/ 24,158 de CMIG4 em 30/06/20	3.313.41	0.02%	0.00%
ss s/ capital de 0.14 a rec. s/ 24,158 de CMIG4 em 30/12/20	3.313.41	0.02%	0.00%
ss s/ capital de 0.15 a rec. s/ 5,800 de RADL3 em 31/05/20	862.10	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.16 a rec. s/ 1,430 de TIMP3 em 31/12/49	223.75	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.16 a rec. s/ 1,562 de RADL3 em 31/12/49	246.38	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.16 a rec. s/ 14,409 de TIMP3 em 31/12/49	2.254.59	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.17 a rec. s/ 2,665 de RADL3 em 31/12/49	420.38	0.00%	0.00%
ss s/ capital de 0.19 a rec. s/ 8,969 de KLBNI1 em 20/02/20	2.937.98	0.02%	0.00%
ss s/ capital de 0.20 a rec. s/ 107,697 de PETR4 em 07/02/20	1.701.83	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.20 a rec. s/ 5,369 de PETR4 em 07/02/20	21.539.40	0.13%	0.01%
ss s/ capital de 0.20 a rec. s/ 77,181 de PETR3 em 07/02/20	1.073.80	0.01%	0.00%
ss s/ capital de 0.23 a rec. s/ 7,272 de HYPE3 em 07/01/20	15.436.20	0.09%	0.01%
ss s/ capital de 0.23 a rec. s/ 7,272 de HYPE3 em 07/01/20	1.660.56	0.01%	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ata de Emissão: 30/01/2020 16:39:40

ata da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: RS - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

cliente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]



033/034

ONTAS A PAGAR / RECEBER

scrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
os s/ capital de 0.26 a rec. s/ 399 de HYPE3 em 07/01/20	101.89	0.00%	0.00%
os s/ capital de 0.26 a rec. s/ 7.715 de HYPE3 em 07/01/20	1.970.18	0.01%	0.00%
os s/ capital de 0.26 a rec. s/ 8.367 de HYPE3 em 07/01/20	2.138.77	0.01%	0.00%
os s/ capital de 0.30 a rec. s/ 1.046 de HYPE3 em 07/01/20	318.23	0.00%	0.00%
os s/ capital de 0.30 a rec. s/ 9.954 de HYPE3 em 07/01/20	3.028.40	0.02%	0.00%
os s/ capital de 0.35 a rec. s/ 4.307 de VIVT4 em 31/12/49	1.499.75	0.01%	0.00%
os s/ capital de 0.42 a rec. s/ 116.413 de PETR4 em 07/02/20	48.893.46	0.28%	0.03%
os s/ capital de 0.42 a rec. s/ 2.239 de CVCB3 em 08/01/20	934.50	0.01%	0.00%
os s/ capital de 0.43 a rec. s/ 4.343 de VIVT4 em 31/12/49	1.857.19	0.01%	0.00%
os s/ capital de 0.43 a rec. s/ 5.695 de EGIE3 em 31/12/49	2.470.84	0.01%	0.00%
os s/ capital de 0.46 a rec. s/ 19.700 de BRDT3 em 30/06/20	9.136.71	0.05%	0.01%
os s/ capital de 0.59 a rec. s/ 4.754 de VIVT4 em 31/12/49	2.811.27	0.02%	0.00%
os s/ capital de 0.59 a rec. s/ 486 de VIVT4 em 31/12/49	287.39	0.00%	0.00%
os s/ capital de 0.80 a rec. s/ 5.772 de BRAP4 em 31/12/49	4.613.45	0.03%	0.00%
os s/ capital de 1.41 a rec. s/ 1.685 de VALE3 em 31/12/49	2.383.20	0.01%	0.00%
ida de Ações [D+2]	106.466.28	0.62%	0.07%
TAL GERAL	3.927.331.20	22.82%	2.62%
	17.208.231.78	100.00%	11.48%

SOURARIA

scrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
do em Tesouraria	7.542.24	100.00%	0.01%
do em Tesouraria RESERVA	0.00	0.00%	0.00%
TAL	7.542.24	100.00%	0.01%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 30/01/2020 16:39:40

Data da Posição: 31/12/2019

Cliente: ITAU CAIXA ACOES FI [CAIXAACOES1624] [702445] [01]

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438



Banco Itaú

034/034

ATRIMÔNIO

149.962.229,27 100,00%

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark	Rent. Reul	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
ata Inicial							
ata Final							
COTA LÍQUIDA	26,9021%	-0,0125%	0,0045973%	6,8574%	31,6233%	14,5694%	31,6233%
DI			0,0170890%	0,3766%	5,9678%	2,8073%	5,9678%

Quantidade de Cotas	3,264,157,72554
Valor da cota unitária	45,942090
Quantidade de Cotas (Bruta)	0,00000
Valor da cota unitária (Bruta)	0,000000
Valor da cota bruta de performance	45,942090



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ata de Emissão: 30/01/2020 16:42:10

ata da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

Cliente: ITAÚ MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO [MOMENTORV461] [700519] [01]



001/007

ENDA VARIÁVEL

CÓES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

Cód.	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio s/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Propria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
SO3	ALIANSCONAEON	846.085	0	846.085	42,19	50,14	35.698.516,39	6.724.185,51	42.422.701,90	0,00	42.422.701,90	3,44%	3,08%
PA4	ALPARGATAS PN	1.256.400	0	1.256.400	31,33	33,20	39.368.023,65	2.344.456,35	41.712.480,00	0,00	41.712.480,00	3,38%	3,03%
SA3	B3 ON NM	1.212.902	375.000	1.587.902	46,03	42,97	73.087.834,10	(4.855.685,16)	68.232.148,94	0,00	68.232.148,94	5,53%	4,96%
DC4	BRADESCO PN	2.210.256	154.000	2.364.256	34,11	36,17	80.634.224,08	4.880.915,44	85.515.139,52	0,00	85.515.139,52	6,93%	6,21%
AC11	BTGP BANCO UNT	662.957	64.100	727.057	72,90	76,13	53.003.919,86	2.346.929,55	55.350.849,41	0,00	55.350.849,41	4,49%	4,02%
FB3	CARREFOUR BRON	450.282	0	450.282	19,28	23,35	8.854.855,26	1.869.379,44	10.724.234,70	0,00	10.724.234,70	0,87%	0,78%
SP6	CESP PNB NI	1.542.500	0	1.542.500	29,96	31,94	46.209.872,97	3.057.577,03	49.267.450,00	0,00	49.267.450,00	3,99%	3,58%
GH11	ENERGISA UNT	590.172	257.000	847.172	48,54	53,53	41.120.107,81	4.229.009,35	45.349.117,16	0,00	45.349.117,16	3,68%	3,29%
EV3	ENEVA ON NM	878.661	58.000	936.661	38,82	43,69	36.356.645,69	4.566.073,40	40.922.719,09	0,00	40.922.719,09	3,32%	2,97%
JTL3	EQUATORIAL ON	1.947.000	130.000	2.077.000	21,63	22,79	44.930.187,94	2.404.642,06	47.334.830,00	0,00	47.334.830,00	3,84%	3,44%
BR4	GERDAU PN NI	36.633	34.000	70.633	17,71	20,00	1.251.215,94	161.444,06	1.412.660,00	0,00	1.412.660,00	0,11%	0,10%
CO3	GRUPO NATURAON	550.576	85.000	635.576	34,27	38,67	21.783.770,36	2.793.953,56	24.577.723,92	0,00	24.577.723,92	1,99%	1,78%
APV3	HAPVIDA ON N	416.000	0	416.000	56,01	63,90	23.301.127,00	3.281.273,00	26.582.400,00	0,00	26.582.400,00	2,15%	1,93%
TA3	IGUATEMI ON N	814.500	21.000	835.500	49,61	52,90	41.452.678,85	2.745.271,15	44.197.950,00	0,00	44.197.950,00	3,58%	3,21%
DI3	INTERMEDICA ON	382.100	0	382.100	57,06	68,25	21.801.204,62	4.277.120,38	26.078.325,00	0,00	26.078.325,00	2,11%	1,89%
JB4	ITAUNIBANCOPN	1.736.408	245.000	1.981.408	35,52	37,10	70.373.039,46	5.851.402,07	76.224.441,53	0,00	76.224.441,53	5,96%	5,34%
JT3	LIGHT S/A ON N	2.197.855	0	2.197.855	21,10	23,76	46.369.632,73	2.881.806,49	49.251.439,22	0,00	49.251.439,22	4,23%	3,79%
NT3	LOCALIZA ON N	1.198.989	97.000	1.295.989	45,19	47,41	58.561.032,00	6.206.489,66	64.767.521,66	0,00	64.767.521,66	4,98%	4,46%
AM3	LOCAMERICA ON	1.443.310	54.000	1.497.310	18,56	22,71	27.797.420,44	3.183.599,71	30.981.020,15	0,00	30.981.020,15	2,76%	2,47%
EN3	LOJAS RENNERTON	860.405	118.000	978.405	52,94	56,19	51.792.977,24	660.425,32	52.453.402,56	0,00	52.453.402,56	4,46%	3,99%
LU3	MAGAZ LUIZA ON	587.024	124.000	711.024	46,77	47,70	33.255.419,48	(708.336,32)	33.963.755,80	0,00	33.963.755,80	2,75%	2,46%
BR3	OI ON NI	9.328.800	1.100.000	10.428.800	0,93	0,86	9.677.104,32	1.503.562,00	11.180.666,32	0,00	11.180.666,32	0,73%	0,65%
TR4	PETROBRAS PN	1.641.193	859.000	2.500.193	29,58	30,18	73.952.462,74	2.420.950,64	76.373.413,38	0,00	76.373.413,38	6,11%	5,48%
DT3	PETROBRAS BRON	1.375.558	209.000	1.584.558	28,54	30,07	45.226.708,42	2.295.178,13	47.521.886,55	0,00	47.521.886,55	3,86%	3,46%
JAL3	QUALICORP ON	680.744	0	680.744	33,73	37,10	22.960.424,27	4.337.145,92	27.297.570,19	0,00	27.297.570,19	2,05%	1,83%
LA11	SUL AMERICA UNT	961.701	280.000	1.241.701	56,43	59,92	70.065.580,00	3.144.610,15	73.210.190,15	0,00	73.210.190,15	6,03%	5,40%
LE3	VALE ON NM	714.524	833.000	1.547.524	51,27	53,30	79.338.419,05	75.740.374,23	155.078.793,28	0,00	155.078.793,28	6,68%	5,99%
TOTAL BOLSA		56.532.535	5.097.100	61.629.635			1.158.224.404,67	75.740.374,23	1.233.964.778,90	0,00	1.233.964.778,90	100,00%	89,62%
TAL		56.532.535	5.097.100	61.629.635			1.158.224.404,67	75.740.374,23	1.233.964.778,90	0,00	1.233.964.778,90	100,00%	89,62%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento



002/007



ata de Emissão: 30/01/2020 16:42:11

ata da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

cliente: ITAÚ MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO [MOMENTORV461] [700519] [01]

IPRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL, MERC E FUTUROS

Operações Doadoras

Cód. Operação	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação		Remun/Rep. Liq	% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR			
47644	20/12/2019	19/03/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	283.326	-89.782	22,18	5.840.570,68	0,49%	0,00%	453,17	0,00	453,17	7,00%	0,42%
47645	20/12/2019	19/03/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	209.571		22,18	4.848.284,78	0,49%	0,00%	360,66	0,00	360,66	5,57%	0,34%
47646	20/12/2019	19/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON NM	948		48,71	46.177,08	0,16%	0,00%	1,17	0,00	1,17	0,06%	0,00%
47647	20/12/2019	19/03/2020	LIGT3	LIGHT S/A ON NM	69.208		21,97	1.520.499,76	0,17%	0,00%	40,99	0,00	40,99	1,82%	0,11%
47648	20/12/2019	19/03/2020	LIGT3	LIGHT S/A ON NM	3.714		21,97	81.596,58	0,17%	0,00%	2,19	0,00	2,19	0,10%	0,01%
47649	20/12/2019	19/03/2020	LIGT3	LIGHT S/A ON NM	20.219		21,97	444.211,43	0,17%	0,00%	11,97	0,00	11,97	0,53%	0,03%
47650	20/12/2019	19/03/2020	LIGT3	LIGHT S/A ON NM	7.462		21,97	163.940,14	0,17%	0,00%	4,42	0,00	4,42	0,20%	0,01%
47651	20/12/2019	19/03/2020	LIGT3	LIGHT S/A ON NM	36.542		21,97	802.827,74	0,17%	0,00%	21,64	0,00	21,64	0,96%	0,06%
47652	20/12/2019	19/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	69.800		21,97	1.533.506,00	0,17%	0,00%	41,34	0,00	41,34	1,84%	0,11%
47653	20/12/2019	19/03/2020	GGBR4	GERDAU PN N1	4.918		36,16	177.834,88	0,12%	0,00%	3,38	0,00	3,38	0,21%	0,01%
47654	20/12/2019	19/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	204.331	-204.331	18,24	3.726.997,44	0,15%	0,00%	88,67	0,00	88,67	4,46%	0,27%
47655	20/12/2019	19/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	22.691		36,16	820.506,56	0,08%	0,00%	10,41	0,00	10,41	0,98%	0,06%
48929	23/12/2019	23/03/2020	NTCO3	GRUPO NATURAON	508.224		39,46	20.054.519,04	1,60%	0,00%	3.790,02	0,00	3.790,02	24,02%	1,46%
49565	23/12/2019	19/03/2020	RENT3	LOCALIZA ON NM	47		48,71	2.289,37	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
49773	26/12/2019	25/03/2020	OIBR3	OI ON N1	801.200		0,87	697.044,00	4,70%	0,00%	254,12	0,00	254,12	0,84%	0,05%
51433	27/12/2019	26/03/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	2.891		36,27	104.856,57	0,11%	0,00%	0,45	0,00	0,45	0,13%	0,01%
51434	27/12/2019	06/02/2020	BRDT3	PETROBRAS BRON	18.342		30,14	552.827,88	0,09%	0,00%	1,97	0,00	1,97	0,66%	0,04%
51435	27/12/2019	06/02/2020	BPAC11	BTGP BANCO UN T	6.343		75,41	478.325,63	0,07%	0,00%	1,32	0,00	1,32	0,57%	0,03%
51436	27/12/2019	06/02/2020	ALSO3	ALIANSCSONAEON	1.825	-244	49,48	90.301,00	0,83%	0,00%	2,96	0,00	2,96	0,11%	0,01%
51437	27/12/2019	06/02/2020	ALSO3	ALIANSCSONAEON	23.020	-16.697	49,48	1.139.029,60	0,83%	0,00%	37,36	0,00	37,36	1,36%	0,08%
51438	27/12/2019	06/02/2020	ALSO3	ALIANSCSONAEON	1.286	-1.052	49,48	63.631,28	0,83%	0,00%	2,08	0,00	2,08	0,08%	0,00%
51439	27/12/2019	06/02/2020	ALSO3	ALIANSCSONAEON	11.544	-8.613	49,48	571.197,12	0,83%	0,00%	18,73	0,00	18,73	0,68%	0,04%
51440	27/12/2019	06/02/2020	ALSO3	ALIANSCSONAEON	880	-57	49,48	43.542,40	0,83%	0,00%	1,42	0,00	1,42	0,05%	0,00%
51441	27/12/2019	06/02/2020	ALSO3	ALIANSCSONAEON	447	-3.119	49,48	22.117,56	0,83%	0,00%	0,72	0,00	0,72	0,03%	0,00%
51442	27/12/2019	06/02/2020	QUAL3	QUALICORP ON N1	3.426		49,48	169.518,48	0,83%	0,00%	5,56	0,00	5,56	0,20%	0,01%
51443	27/12/2019	06/02/2020	QUAL3	QUALICORP ON N1	1.453		37,72	54.807,16	0,09%	0,00%	0,19	0,00	0,19	0,07%	0,00%
51444	27/12/2019	06/02/2020	QUAL3	QUALICORP ON N1	7.282		37,72	274.677,04	0,09%	0,00%	0,98	0,00	0,98	0,33%	0,02%
51445	27/12/2019	06/02/2020	B3SA3	B3 ON NM	1.803	-454	48,62	84.055,86	0,08%	0,00%	0,26	0,00	0,26	0,10%	0,01%
51446	27/12/2019	06/02/2020	BBD4	BRADESCO PN N1	2.839	-2.839	36,27	102.970,53	0,08%	0,00%	0,32	0,00	0,32	0,12%	0,01%
51447	27/12/2019	06/02/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	2.699	-2.199	23,25	62.751,75	0,45%	0,00%	1,11	0,00	1,11	0,08%	0,00%
51448	27/12/2019	06/02/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	23.669	-22.801	23,25	550.304,25	0,45%	0,00%	9,80	0,00	9,80	0,66%	0,04%
51449	27/12/2019	06/02/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	7.188	-6.588	23,25	167.121,00	0,45%	0,00%	2,97	0,00	2,97	0,20%	0,01%

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 30/01/2020 16:42:11

Data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

Cliente: ITAÚ MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO [MOMENTORV461] [700519] [01]



Banco Itaú

003/007

MPRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA - BMF BOVESPA S.A. - BOLSA DE VAL. MERC E FUTUROS

Operações Doadoras

Cód. Operação	Dt. Operação	Dt. Venc.	Cód.	Papel	Quantidade	Quantidade em Liquidação	Preço	Financeiro	% Remun.	% Mercado	Apropriação			% S/ EA	% S/ Total
											Remun/Rep. Bruto	IR	Remun/Rep. Liq		
151450	27/12/2019	06/02/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	3.830		23,25	89.047,50	0,45%	0,00%	1,58	0,00	1,58	0,11%	0,01%
151451	27/12/2019	06/02/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	938	-938	23,25	21.808,50	0,45%	0,00%	0,38	0,00	0,38	0,03%	0,00%
151452	27/12/2019	06/02/2020	CRFB3	CARREFOUR BRON	48.297	-48.297	23,25	1.122.905,25	0,45%	0,00%	20,00	0,00	20,00	1,35%	0,08%
151453	27/12/2019	06/02/2020	SULA11	SUL AMERICA UNT	1.100	-1.100	58,04	63.844,00	0,90%	0,00%	2,26	0,00	2,26	0,08%	0,00%
151454	27/12/2019	06/02/2020	SULA11	SUL AMERICA UNT	8.641	-8.641	58,04	501.523,64	0,90%	0,00%	17,83	0,00	17,83	0,60%	0,04%
151455	27/12/2019	06/02/2020	SULA11	SUL AMERICA UNT	1.561	-1.561	58,04	90.600,44	0,90%	0,00%	3,22	0,00	3,22	0,11%	0,01%
151456	27/12/2019	06/02/2020	SULA11	SUL AMERICA UNT	4.097	-4.097	58,04	237.789,88	0,90%	0,00%	8,45	0,00	8,45	0,28%	0,02%
151457	27/12/2019	06/02/2020	MGLU3	MAGAZ LUIZA ON	3.012		48,92	147.347,04	0,09%	0,00%	0,52	0,00	0,52	0,18%	0,01%
151458	27/12/2019	06/02/2020	LREN3	LOJAS RENNERTON	3.195	-3.195	56,77	181.380,15	0,12%	0,00%	0,86	0,00	0,86	0,22%	0,01%
52350	30/12/2019	30/03/2020	BBD4	BRADESCO PN	9.065		36,30	329.059,50	0,08%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,39%	0,02%
52351	30/12/2019	30/03/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN	394		37,31	14.700,14	0,08%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,02%	0,00%
52352	30/12/2019	30/03/2020	MGLU3	MAGAZ LUIZA ON	664		48,59	32.263,76	0,40%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,04%	0,00%
52353	30/12/2019	30/03/2020	GGBR4	GERDAU PN	12.136		19,86	241.020,96	0,21%	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,29%	0,02%
52354	30/12/2019	30/03/2020	ENGI11	ENERGISA UNT	103.936		53,27	5.536.670,72	0,28%	0,00%	0,00	0,00	0,00	6,63%	0,40%
52355	30/12/2019	30/03/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN	443.332		37,31	16.540.716,92	0,05%	0,00%	0,00	0,00	0,00	19,81%	1,20%
52356	30/12/2019	30/03/2020	ITUB4	ITAUNIBANCOPN	354.666		37,31	13.232.588,46	0,05%	0,00%	0,00	0,00	0,00	15,85%	0,96%
Total								83.476.107,45			5.227,45	0,00	5.227,45	100,00%	6,06%
TOTAL BOLSA								83.476.107,45			5.227,45	0,00	5.227,45	100,00%	6,06%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 30/01/2020 16:42:11
 Data da Posição: 31/12/2019
 Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17.5438
 Instrumento: ITAÚ MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO [MOMENTORV461] [700519] [01]



004/007

ENDIA FIXA

MERCADO NACIONAL

Ítem	Aplicação	Emissor	Papel	MTM %AA	Tx Over	Taxa %AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Atual	Valor da Aplicação	Vlr Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
6371	25/03/19	TESOURO	1779663	0,008300%	0,513688%	0,009631%	sole	01/07/00	01/03/22	44,0000	10,468,2335780	440,758,68	0,00	440,602,27	0,00	440,602,27	0,29%	0,03%
TOTAL OPERAÇÕES À VISTA																		
										44,0000		440,758,68	0,00	440,602,27	0,00	440,602,27	0,29%	0,03%
TOTAL LETRA FIN. TESOURO																		
										44,0000		440,758,68	0,00	440,602,27	0,00	440,602,27	0,29%	0,03%
TOTAL MERCADO NACIONAL																		
										44,0000		440,758,68	0,00	440,602,27	0,00	440,602,27	0,29%	0,03%
TOTAL																		
										44,0000		440,758,68	0,00	440,602,27	0,00	440,602,27	100,00%	0,03%

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

MERCADO NACIONAL

gr	Aquisição	Emissor	Papel	MTM %AA	Tx Over	Taxa %AA	Index	Emissão	Vencido	Resgate	Quantidade	PU	Valor da Aplicação	Valor do Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total	
OVER																				
97	31/12/2019	TESOURO	LFT	0,000000%	0,000000%	4,400000%	pre	01/07/00	01/09/21	02/01/20	527,0000	10,458,06762427	5,511,401,63	5,512,343,45	5,511,401,63	0,00	5,511,401,63	3,47%	0,40%	
											527,0000			5,511,401,63	5,512,343,45	5,511,401,63	0,00	5,511,401,63	3,47%	0,40%
UNDER																				
33	31/12/2019	TESOURO	LTN	0,000000%	0,000000%	4,400000%	pre	06/07/18	01/10/20	02/01/20	158,386,0000	963,81791689	152,655,264,58	152,681,351,16	152,655,264,58	0,00	152,655,264,58	96,24%	11,09%	
											158,386,0000			152,655,264,58	152,681,351,16	152,655,264,58	0,00	152,655,264,58	96,24%	11,09%
UNDER																				
32	30/12/2019	TESOURO	NTN-F	0,000000%	0,512657%	4,400000%	pre	05/02/10	01/01/21	31/12/19	0,0000	1,093,28089164	0,00	153,388,402,37	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	
											0,0000			0,00	153,388,402,37	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
											158,913,0000			158,166,666,21	311,582,096,98	158,166,666,21	0,00	158,166,666,21	99,71%	11,49%
											158,913,0000			158,166,666,21	311,582,096,98	158,166,666,21	0,00	158,166,666,21	99,71%	11,49%
TOTAL MERCADO NACIONAL																				
											0,0000			0,00	153,388,402,37	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
											158,913,0000			158,166,666,21	311,582,096,98	158,166,666,21	0,00	158,166,666,21	99,71%	11,49%
											158,913,0000			158,166,666,21	311,582,096,98	158,166,666,21	0,00	158,166,666,21	99,71%	11,49%

DEBITOS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Prêmio de Ações [D+1]	(52.003.184,17)	332,05%	(3,78%)
Prêmio de Ações [D+2]	(50.627.629,08)	323,26%	(3,68%)
Resgate de Livro em 31/12/20	(297,72)	0,00%	(0,00%)
Resgate de Ações	(1.914.390,41)	12,22%	(0,14%)



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Banco Itaú



005/007



data de Emissão: 30/01/2020 16:42:11

data da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAÚ MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO [MOMENTORV461] [700519] [01]

NTAS A PAGAR / RECEBER

scrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
sto CETIP 08/01/2020	(1.924,93)	0,01%	(0,00%)
sto SELIC 15/01/2020	(54,95)	0,00%	(0,00%)
spesa de AUDITORIA com pagamento 26/10/2020	(2.587,72)	0,02%	(0,00%)
spesa de Cartório - Atas/Livros Eletronicos com pagamento 31/12/2020	(103,34)	0,00%	(0,00%)
spesa de Taxa CBLC (CCBA)	(1.764,88)	0,01%	(0,00%)
spesas com Impressos em 24/01/20	(2,37)	0,00%	(0,00%)
crimento de despesa de Taxa Bimestral ANBID com vencimento 31/01/2020	557,67	(0,00%)	0,00%
idendo de 0,02 a rec. s/ 2.595,894 de ITSA4 em 02/01/2020	51.917,88	(0,33%)	0,00%
idendo de 0,02 a rec. s/ 2.720,800 de ITUB4 em 02/01/2020	40.812,00	(0,26%)	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel ALSO3 na ITAUCOR em 06/02/20	2.127,339,92	(13,58%)	0,15%
pr. de Ações a receber para o papel B3SA3 na ITAUCOR em 06/02/20	77.474,91	(0,49%)	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 06/02/20	102.686,63	(0,66%)	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 26/03/20	998.617,53	(6,38%)	0,07%
pr. de Ações a receber para o papel BBDC4 na ITAUCOR em 30/03/20	104.567,47	(0,67%)	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel BPAC11 na ITAUCOR em 06/02/20	327.881,05	(2,09%)	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel BRDT3 na ITAUCOR em 06/02/20	482.892,59	(3,08%)	0,04%
pr. de Ações a receber para o papel CRFB3 na ITAUCOR em 06/02/20	551.543,94	(3,52%)	0,04%
pr. de Ações a receber para o papel ENGI11 na ITAUCOR em 30/03/20	2.022.600,35	(12,91%)	0,15%
pr. de Ações a receber para o papel CRFB3 na ITAUCOR em 19/03/20	11.042.144,95	(70,51%)	0,80%
pr. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 19/03/20	5.563.694,08	(35,52%)	0,40%
pr. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 30/03/20	4.086.620,00	(26,09%)	0,30%
pr. de Ações a receber para o papel GGBR4 na ITAUCOR em 30/03/20	242.720,00	(1,55%)	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel LGIT3 na ITAUCOR em 19/03/20	29.620.343,20	(189,13%)	2,15%
pr. de Ações a receber para o papel LREN3 na ITAUCOR em 06/02/20	4.917.013,20	(31,40%)	0,36%
pr. de Ações a receber para o papel LREN3 na ITAUCOR em 06/02/20	179.527,05	(1,15%)	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel MGLU3 na ITAUCOR em 06/02/20	143.672,40	(0,92%)	0,01%
pr. de Ações a receber para o papel MGLU3 na ITAUCOR em 30/03/20	31.672,80	(0,20%)	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel NTCO3 na ITAUCOR em 23/03/20	19.653.022,08	(125,49%)	1,43%
pr. de Ações a receber para o papel OIBR3 na ITAUCOR em 25/03/20	689.032,00	(4,40%)	0,05%
pr. de Ações a receber para o papel QUAL3 na ITAUCOR em 06/02/20	324.068,50	(2,07%)	0,02%
pr. de Ações a receber para o papel RENT3 na ITAUCOR em 19/03/20	47.172,95	(0,30%)	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel SULA11 na ITAUCOR em 06/02/20	922.708,08	(5,89%)	0,07%
pr. de Ações a receber para o papel SULA11 na ITAUCOR em 06/02/20	(246,90)	0,00%	(0,00%)
pr. de Ações a receber para o papel SULA11 na ITAUCOR em 06/02/20	68,83	(0,00%)	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel SULA11 na ITAUCOR em 06/02/20	0,26	(0,00%)	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel SULA11 na ITAUCOR em 06/02/20	0,32	(0,00%)	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel SULA11 na ITAUCOR em 06/02/20	13,79	(0,00%)	0,00%
pr. de Ações a receber para o papel SULA11 na ITAUCOR em 06/02/20	0,45	(0,00%)	0,00%

imo de Juros s/ capital de 0,08 a rec. s/ 3,195 de LREN3 em 31/12/49

ira de Empr. de Ações Doadora do papel [ALSO3] na ITAUCOR em 06/02/20

ira de Empr. de Ações Doadora do papel [B3SA3] na ITAUCOR em 06/02/20

ira de Empr. de Ações Doadora do papel [BBDC4] na ITAUCOR em 06/02/20

ira de Empr. de Ações Doadora do papel [BBDC4] na ITAUCOR em 19/03/20

ira de Empr. de Ações Doadora do papel [BBDC4] na ITAUCOR em 26/03/20

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

ta de Emissão: 30/01/2020 16:42:11

ta da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAÚ MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO [MOMENTORV461] [700519] [01]



Banco Itaú

006/007

INTAS A PAGAR / RECEBER

crição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [BPAC11] na ITAUCOR em 06/02/20	1.32	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [BRDT3] na ITAUCOR em 06/02/20	1.97	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [CRFB3] na ITAUCOR em 06/02/20	35.84	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [CRFB3] na ITAUCOR em 19/03/20	813.83	(0.01%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [GGBR4] na ITAUCOR em 19/03/20	88.67	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [LIGT3] na ITAUCOR em 19/03/20	122.55	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [LREN3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.86	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [MGLU3] na ITAUCOR em 06/02/20	0.52	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [NTCO3] na ITAUCOR em 23/03/20	3.790.02	(0.02%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [OIBR3] na ITAUCOR em 25/03/20	254.12	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [QUAL3] na ITAUCOR em 06/02/20	1.17	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [RENT3] na ITAUCOR em 19/03/20	1.17	(0.00%)	0.00%
ira de Empr. de Ações Doadora do papel [SULA11] na ITAUCOR em 06/02/20	31.76	(0.00%)	0.00%
is s/ cap. a rec. s/ 3.195 de LREN3 em 31/12/2049 - Emp.Ações ITAUCOR [CC/]	246.90	(0.00%)	0.00%
is s/ capital de 0.02 a rec. s/ 1.896.660 de BBDC4 em 02/01/20	35.988.76	(0.23%)	0.00%
is s/ capital de 0.02 a rec. s/ 602.472 de BBDC3 em 02/01/20	10.392.53	(0.07%)	0.00%
is s/ capital de 0.03 a rec. s/ 1.053.077 de GUAR3 em 31/12/49	34.330.31	(0.22%)	0.00%
is s/ capital de 0.03 a rec. s/ 1.365.960 de GUAR3 em 31/12/49	40.978.80	(0.26%)	0.00%
is s/ capital de 0.04 a rec. s/ 1.546.800 de ITUB4 em 30/04/20	58.097.80	(0.37%)	0.00%
is s/ capital de 0.04 a rec. s/ 45.800 de WEGE3 em 11/03/20	1.872.41	(0.01%)	0.00%
is s/ capital de 0.08 a rec. s/ 337.069 de LREN3 em 31/12/49	26.173.40	(0.17%)	0.00%
is s/ capital de 0.08 a rec. s/ 863.600 de LREN3 em 31/12/49	66.737.28	(0.43%)	0.00%
is s/ capital de 0.08 a rec. s/ 97.878 de LREN3 em 31/12/49	7.692.03	(0.05%)	0.00%
is s/ capital de 0.09 a rec. s/ 38.700 de LREN3 em 31/12/49	3.596.97	(0.02%)	0.00%
is s/ capital de 0.10 a rec. s/ 676.700 de RENT3 em 14/02/20	67.495.65	(0.43%)	0.00%
is s/ capital de 0.15 a rec. s/ 1.103.566 de SULA11 em 17/04/20	171.000.42	(1.09%)	0.01%
is s/ capital de 0.16 a rec. s/ 1.013.466 de TIMP3 em 31/12/49	158.578.28	(1.01%)	0.01%
is s/ capital de 0.16 a rec. s/ 15.600 de RADL3 em 31/12/49	2.460.74	(0.02%)	0.00%
is s/ capital de 0.19 a rec. s/ 912.742 de MYPK3 em 31/03/20	168.913.49	(1.08%)	0.01%
is s/ capital de 0.20 a rec. s/ 362.417 de PETR3 em 07/02/20	72.483.40	(0.46%)	0.01%
is s/ capital de 0.20 a rec. s/ 579.493 de PETR4 em 07/02/20	115.898.60	(0.74%)	0.01%
is s/ capital de 0.28 a rec. s/ 571.100 de SULA11 em 17/04/20	162.127.09	(1.04%)	0.01%
is s/ capital de 0.35 a rec. s/ 41.800 de VIVT4 em 31/12/49	14.555.25	(0.09%)	0.00%
is s/ capital de 0.42 a rec. s/ 1.991.193 de PETR4 em 07/02/20	836.301.06	(5.34%)	0.06%
is s/ capital de 0.43 a rec. s/ 54.000 de VIVT4 em 31/12/49	23.091.94	(0.15%)	0.00%
is s/ capital de 0.44 a rec. s/ 98.608 de GUAR3 em 31/12/49	43.841.11	(0.28%)	0.00%
is s/ capital de 0.46 a rec. s/ 1.287.600 de BRDT3 em 30/06/20	597.179.17	(3.81%)	0.04%
is s/ capital de 0.59 a rec. s/ 41.800 de VIVT4 em 31/12/49	24.718.40	(0.16%)	0.00%



Relatório de Carteira Diária - Fechamento

a de Emissão: 30/01/2020 16:42:11

a da Posição: 31/12/2019

Moeda da Carteira: R\$ - REAL 16 HORAS - Taxa de Câmbio: - R\$ 17,5438

ente: ITAÚ MOMENTO AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO [MOMENTORV461] [700519] [01]



007/007

NTAS A PAGAR / RECEBER

crição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
s s/ capital de 1,41 a rec. s/ 1,264,524 de VALES em 31/12/49	1.788.497,68	(11,42%)	0,13%
FAL GERAL	(15.661.406,32)	100,00%	(1,14%)

SOURARIA

crição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
o em Tesouraria	8.035,29	100,00%	0,00%
o em Tesouraria RESERVA	0,00	0,00%	0,00%
FAL	8.035,29	100,00%	0,00%

IRIMÔNIO

1.376.938.676,35	100,00%
------------------	---------

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
a Inicial							
a Final							
IA LÍQUIDA	11,0116%	-0,0152%	0,0018818%	10,3184%	39,8333%	20,5349%	39,8333%
VFECH	0,0000%	0,0019%	0,0170890%	0,3766%	5,9678%	2,8073%	5,9678%
			0,00000000%	6,8482%	31,5837%	14,5375%	31,5837%

quantidade de Cotas	11.880.076,75145
lor da cota unitária	115,903180
quantidade de Cotas (Bruta)	0,00000
lor da cota unitária (Bruta)	0,000000
lor da cota bruta de performance	115,903180

REGULAMENTO DO ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

CNPJ – 16.718.302/0001-30



I) CONDIÇÕES ESPECÍFICAS DO FUNDO

1. PRESTADORES DE SERVIÇO

1.1. ADMINISTRADOR

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM nº 990 de 06/07/1989.

1.2. GESTOR

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM nº 990 de 06/07/1989.

1.3. CUSTÓDIA, TESOUREARIA E ESCRITURAÇÃO DE COTAS

Itaú Unibanco S.A., Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, nº 100, Torre Olavo Setubal, São Paulo – SP, CNPJ nº 60.701.190/0001-04, ato declaratório CVM para a prestação da atividade de custódia de ativos financeiros nº 1.524 de 3/10/1990.

2. PÚBLICO ALVO

O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

3. CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

O FUNDO é constituído como condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração e classificado como “ações”.

4. POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O objetivo do FUNDO é 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.

4.1. O FUNDO aplica em fundos de investimento que utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

2. A descrição detalhada da política de investimento do FUNDO está prevista no Anexo I. Os limites estabelecidos no Anexo I deste regulamento devem ser considerados em conjunto e cumulativamente, prevalecendo a regra mais restritiva. Características adicionais relacionadas ao objetivo do FUNDO também estão previstas no formulário de informações complementares.

5. REMUNERAÇÃO

A taxa de administração é de 2,5% (dois vírgula cinco por cento) ao ano, sobre o patrimônio do FUNDO.

5.1. A remuneração prevista acima engloba as taxas de administração dos fundos investidos e os pagamentos devidos aos prestadores de serviços do FUNDO, inclusive de custódia, porém não inclui os valores referentes à remuneração do prestador de serviço de auditoria das demonstrações financeiras do FUNDO nem os valores correspondentes aos demais encargos do FUNDO, os quais serão debitados do FUNDO de acordo com o disposto neste regulamento e na regulamentação.

5.1.1. Serão desconsideradas, para fins de cálculo da taxa de administração do FUNDO, as taxas cobradas por fundos integrantes da carteira do FUNDO, quando se tratar de fundos de índice ou imobiliário, ou ainda, quando geridos por partes não relacionadas ao GESTOR.

5.2. A taxa de administração será provisionada por dia útil, mediante divisão da taxa anual por 252 dias e apropriada mensalmente.

5.3. O ADMINISTRADOR receberá também taxa de performance, equivalente a 20% (vinte por cento) da rentabilidade do FUNDO que exceder a 100% (cem por cento) da variação do Ibovespa de um dia, apurado pela BM&FBovespa. A taxa de performance será calculada a partir da valorização dos ativos do FUNDO, provisionada por dia útil como despesa do

FUNDO e apropriada, no mês subsequente ao encerramento dos meses de dezembro e junho de cada ano, desde que o período não seja inferior a 6 (seis) meses, ou proporcionalmente, na hipótese de resgate.

5.3.1. A taxa de performance somente será devida se o valor da cota do FUNDO ao final de cada período de cálculo for superior ao seu valor na data da última cobrança da taxa de performance ou no início do FUNDO, no caso da primeira cobrança.

5.3.2. Para fins do cálculo da taxa de performance, o valor da cota do FUNDO no momento de apuração do resultado deve ser comparado ao valor da cota, logo após a última cobrança de taxa de performance efetuada ("cota base"), atualizado pelo índice de referência do período transcorrido desde a última cobrança de taxa de performance ou do início do FUNDO, no caso de primeira cobrança.

5.3.2.1. Caso o valor da cota base atualizada pelo índice de referência seja inferior ao valor da cota base, a taxa de performance a ser provisionada e apropriada deve ser (i) calculada sobre a diferença entre o valor da cota antes de descontada a provisão para a apropriação da taxa de performance e o valor da cota base atualizada pelo índice de referência; e (ii) limitada à diferença entre o valor da cota antes de descontada a provisão para a apropriação da taxa de performance e a cota base.

5.3.4. A taxa de performance será cobrada após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive da taxa de administração.

5.4. O FUNDO não cobra taxa de ingresso ou de saída.

5.5. Os fundos investidos podem cobrar taxa de performance, ingresso e/ou de saída de acordo com os seus respectivos regulamentos.

6. APLICAÇÕES

As aplicações ocorrerão mediante: (i) instrução verbal, escrita ou eletrônica (se disponível) ao distribuidor ou diretamente ao ADMINISTRADOR; (ii) adesão aos documentos exigidos pela regulamentação, significando que ele teve acesso ao inteiro teor de tais documentos, conhece os riscos de investir no FUNDO e está ciente de que o ADMINISTRADOR, o GESTOR e empresas ligadas podem manter negócios com emissores de ativos financeiros do FUNDO; e (iii) depósito ou transferência eletrônica do valor do investimento à conta do FUNDO.

6.1. Será admitido o investimento conjunto e solidário por duas pessoas físicas para aquisição de uma mesma cota. Nessa situação os coinvestidores estabelecem entre si a solidariedade ativa, sendo assim considerados em conjunto como um único titular das cotas. Desse modo, cada coinvestidor, isoladamente pode investir e solicitar o resgate, bem como receber resgate, parcial ou total, enfim praticar todo e qualquer ato inerente à propriedade de cotas, ficando o FUNDO e seu ADMINISTRADOR exonerados de responsabilidade no cumprimento de referidas ordens, inclusive ao disponibilizar os recursos a qualquer dos dois cotistas de forma isolada ou conjunta.

6.2. Os recursos aportados serão convertidos em cotas escriturais, nominativas e correspondentes a frações ideais do patrimônio do FUNDO.

6.3. O investidor será considerado cotista a partir da inscrição do seu nome no registro de cotistas, que pode se dar inclusive por meio de sistemas informatizados.

6.4. A cota do FUNDO terá seu valor atualizado nos dias úteis, permanecerá escriturada em nome do cotista e não poderá ser cedida nem transferida, salvo nas situações previstas na regulamentação.

6.5. As aplicações no FUNDO poderão ser suspensas a qualquer momento e por prazo indeterminado.

6.6. Para emissão das cotas, será utilizado o valor da cota de fechamento de D+0 da solicitação (cota de fechamento é aquela obtida a partir do patrimônio apurado depois do encerramento dos mercados em que o FUNDO atue).

6.7. Os valores mínimos para aplicações iniciais e adicionais serão divulgados por meio do formulário de informações complementares, bem como da lâmina de informações essenciais, se houver.

6.7.1. O cotista deverá observar os seguintes limites:

(i) valor mínimo para resgate: R\$ 1,00 (um real);

(ii) valor mínimo para permanência no FUNDO: R\$ 250,00 (duzentos e cinquenta reais); e

(iii) percentual máximo de cotas que pode ser detido por um único cotista: 100%, exceto se expressamente vedado pela regulamentação aplicável ao cotista do FUNDO.

6.7.2. Pedidos de resgate que resultarem em investimento no FUNDO inferior ao valor mínimo de permanência serão transformados em resgate total.

7. RESGATES

Os resgates ocorrerão mediante:

(i) instrução verbal, escrita ou eletrônica (se disponível) do cotista ao distribuidor ou diretamente ao ADMINISTRADOR;

(ii) conversão de cotas em recursos baseada no valor da cota de fechamento de D+21 (úteis) da solicitação; e

7.1. Os recursos provenientes do resgate serão disponibilizados na conta corrente de titularidade do cotista cadastrada no registro de cotistas do FUNDO, mediante crédito em conta corrente, caso esta seja mantida no Itaú Unibanco, ou transferência eletrônica (com as tarifas incidentes), caso esta seja mantida em outra instituição.

7.2. No caso de fechamento dos mercados e/ou em casos excepcionais de iliquidez dos ativos financeiros do FUNDO, inclusive decorrentes de pedidos de resgates incompatíveis com a liquidez existente, ou que possam implicar alteração do tratamento tributário do FUNDO ou do conjunto dos cotistas, em prejuízo destes últimos, o ADMINISTRADOR pode declarar o fechamento do FUNDO para a realização de resgates.

7.2.1. Caso o ADMINISTRADOR declare o fechamento do FUNDO para a realização de resgates nos termos acima, deve proceder à imediata divulgação de fato relevante, tanto por ocasião do fechamento, quanto da reabertura do FUNDO.

7.2.2. Caso o FUNDO permaneça fechado por período superior a 5 (cinco) dias consecutivos, o ADMINISTRADOR deve obrigatoriamente, além da divulgação de fato relevante por ocasião do fechamento a que se refere o item acima, convocar no prazo máximo de 1 (um) dia, para realização em até 15 (quinze), assembleia geral extraordinária para deliberar sobre as seguintes possibilidades: (i) substituição do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de ambos; (ii) reabertura ou manutenção do fechamento do FUNDO para resgate; (iii) possibilidade do pagamento de resgate em ativos financeiros; (iv) cisão do FUNDO; e (v) liquidação do FUNDO.

8. EXERCÍCIO SOCIAL

O exercício social do FUNDO tem início no primeiro dia do mês de dezembro e término no último dia do mês de novembro de cada ano.

II - CONDIÇÕES GERAIS DO FUNDO



1. RISCOS

O objetivo e a política de investimento do FUNDO não constituem promessa de rentabilidade e o cotista assume os riscos decorrentes do investimento no FUNDO, ciente da possibilidade de eventuais perdas.

1.1. A rentabilidade da cota não coincide com a rentabilidade dos ativos financeiros que compõem a carteira do FUNDO em decorrência dos encargos incidentes sobre o FUNDO e dos tributos incidentes sobre os recursos investidos.

1.2. As aplicações realizadas no FUNDO não têm garantia do ADMINISTRADOR, nem do GESTOR e nem do Fundo Garantidor de Créditos.

1.3. Como todo investimento, o FUNDO apresenta riscos, destacando-se:

MERCADO

Os ativos financeiros de titularidade do FUNDO estão sujeitos às oscilações dos mercados em que são negociados. Em especial pelo mercado de ações, que, por sua característica, apresenta-se sujeito a riscos que são originados por fatores que compreendem, mas não se limitam a: (i) fatores macroeconômicos; (ii) fatores de conjuntura política; e (iii) fatores específicos das empresas emissoras destas ações. Estes riscos afetam seus preços e produzem flutuações no valor das cotas do FUNDO, que podem representar ganhos ou perdas para os cotistas.

Os ativos financeiros do FUNDO têm seus valores atualizados diariamente (marcação a mercado) e tais ativos são estabilizados pelo preço de negociação no mercado ou pela melhor estimativa de valor que se obteria nessa negociação, motivo pelo qual o valor da cota do FUNDO poderá sofrer oscilações frequentes e significativas, inclusive num mesmo dia.

A natureza dos riscos de mercado associados ao investimento no exterior e ao investimento no mercado local é similar, mas o comportamento do mercado em outros países e os efeitos provocados na carteira do FUNDO pelos ativos que possuem risco de mercado externo, mesmo que de forma sintetizada no mercado local, podem ser diversos.

OPERACIONAL

A negociação e os valores dos ativos financeiros do FUNDO podem ser afetados por fatores exógenos diversos, tais como interferências de autoridades governamentais e órgãos reguladores nos mercados, moratórias, alterações da política monetária ou da regulamentação aplicável aos fundos de investimento e/ou a suas operações, podendo, eventualmente, causar perdas aos cotistas.

A realização de operações de derivativos pode (i) aumentar a volatilidade do FUNDO, (ii) limitar ou ampliar as possibilidades de retornos, (iii) não produzir os efeitos pretendidos e/ou (iv) determinar perdas ou ganhos aos cotistas do FUNDO. Adicionalmente, ainda que as operações de derivativos tenham objetivo de proteção da carteira contra determinados riscos, não é possível garantir a inexistência de perdas se ocorrerem os riscos que se pretendia proteger.

Apesar dos esforços de seleção, acompanhamento e diligência nas aplicações do FUNDO em outros fundos de investimento, o ADMINISTRADOR e o GESTOR não têm ingerência na condução dos negócios dos fundos investidos e não respondem por eventuais perdas que estes venham a sofrer.

As operações do fundo estão sujeitas a riscos operacionais ligados aos ambientes em que são negociados, tais como: (i) falha de uma determinada bolsa ou fonte de informações; e (ii) interrupção de operações no local de negociação/registo destas, por exemplo, em eventos decorrentes de feriados.

Por motivos e/ou fatores exógenos à vontade do GESTOR, eventos de transferência de recursos ou de títulos podem não ocorrer conforme o previsto. Estes motivos e fatores incluem, por exemplo, inadimplência do intermediário ou das partes, falhas, interrupções, atrasos ou bloqueios nos sistemas ou serviços das centrais depositárias, *clearings* ou sistemas de liquidação, contrapartes centrais garantidoras ou do banco liquidante envolvidos na liquidação dos referidos eventos.

A utilização de modelos para estimar preços de determinados ativos e/ou estimar o comportamento futuro destes ativos, expõe o FUNDO a riscos de imprecisão ou mesmo de diferenças entre preços conforme os prestadores de serviço de controladoria, o que pode resultar em preços diferentes para um mesmo ativo em distintas carteiras no mercado.

CONCENTRAÇÃO

LIQUIDEZ

Dependendo das condições do mercado, os ativos financeiros do FUNDO podem sofrer diminuição de possibilidade de negociação. Nesses casos, o GESTOR poderá, eventualmente, ver-se obrigado a aceitar descontos ou deságios na venda dos ativos (ou de ágio na compra), prejudicando a rentabilidade do fundo.

Apesar do esforço e diligência do Gestor e Administrador em manter a liquidez da carteira do fundo adequada ao prazo de pagamento de resgates, existe o risco de descasamento entre a efetiva liquidez e o prazo para pagamento dos resgates. Isso pode acontecer em função de momentos atípicos de mercado ou por falha em modelo de estimativa de liquidez que se baseia em dados estatísticos e observações de mercado.

Por prever a alocação de recursos em instrumentos com potencial de retorno superior ao de instrumentos tradicionais, porém com potencial de negociabilidade no mercado mais restrita que os instrumentos convencionais, o FUNDO poderá ter que aceitar deságios em relação ao preço esperado de seus instrumentos e com isso impactar negativamente a sua rentabilidade.

CRÉDITO

As operações do FUNDO estão sujeitas à inadimplência ou mora dos emissores dos seus ativos financeiros e contrapartes, inclusive centrais garantidoras e prestadores de serviços envolvidos no trânsito de recursos do FUNDO, caso em que o FUNDO poderá (i) ter reduzida a sua rentabilidade, (ii) sofrer perdas financeiras até o limite das operações contratadas e não liquidadas e/ou (iii) ter desvalorização de parte ou todo o valor alocado nos ativos financeiros.

2. MONITORAMENTO DE RISCOS

São utilizadas no FUNDO técnicas de monitoramento de risco ("monitoramento") para obter estimativa do seu nível de exposição aos riscos acima mencionados, de forma a adequar os investimentos do FUNDO a seus objetivos.

2.1. Os níveis de exposição a risco (i) são definidos em comitês que contam com a participação dos principais executivos das áreas ligadas à gestão de recursos; (ii) são aferidos por área de monitoramento de risco especializada e segregada da mesa de operações; e (iii) podem ser obtidos por meio de uma ou mais das seguintes ferramentas matemático-estatísticas, dependendo dos mercados em que o FUNDO atuar:

(a) monitoramento de alavancagem – alavancagem é a utilização de operações que expõem o FUNDO a mercados de risco em percentual superior ao seu patrimônio, com o consequente aumento dos riscos e da possibilidade de perdas;

(b) VaR – Valor em Risco – estimativa da perda potencial para a carteira do FUNDO, em dado horizonte de tempo, associado a uma probabilidade ou nível de confiança estatístico

(c) teste de estresse – medida de risco para avaliar o comportamento da carteira do FUNDO em condições significativamente adversas de mercado, baseada em cenários passados, projetados de forma qualitativa ou ainda por métodos quantitativos

(d) tracking risk – estimativa para medir o risco de o FUNDO não seguir a performance de seu objetivo de investimento;

(e) monitoramento de liquidez – apuração do valor total dos ativos passíveis de liquidação financeira em um determinado prazo, ponderado pelas regras de resgate e pela composição da carteira do FUNDO, atribuindo-se probabilidades para a negociação desses ativos nas condições de mercado vigentes.

2.2. O monitoramento (i) leva em conta as operações do FUNDO; (ii) utiliza dados históricos e suposições para tentar prever o comportamento da economia e, consequentemente, os possíveis cenários que eventualmente afetem o FUNDO, mas não há como garantir a precisão desses cenários; e (iii) não elimina a possibilidade de perdas.

2.3. As simulações e estimativas utilizadas no monitoramento dependem de fontes externas de informação, motivo pelo qual o ADMINISTRADOR isenta-se de responsabilidade se tais fontes fornecerem dados incorretos, incompletos ou suspenderem a divulgação dos dados, prejudicando o monitoramento.

3. APURAÇÃO DO VALOR DOS ATIVOS FINANCEIROS DO FUNDO

O valor dos ativos financeiros do FUNDO será apurado diariamente. O cálculo se baseará no manual de precificação do controlador, preferencialmente, com referência em fontes públicas. O valor dos ativos financeiros refletirá no valor global do patrimônio do FUNDO, que embasará o cálculo do valor da cota.

4. APLICAÇÕES E RESGATES EM DIAS SEM EXPEDIENTE BANCÁRIO

As aplicações e os resgates solicitados em dias **sem expediente bancário**:

(i) **nacional** serão processadas da seguinte forma: (a) aplicações, no dia útil subsequente em que houver expediente bancário, e (b) resgates não poderão ser solicitados;

4.1. As liquidações de resgates em dias sem expediente bancário nacional, ou ainda, estadual ou municipal, na praça da conta corrente do cotista, ocorrerão no dia subsequente em que houver expediente bancário naquela praça.

4.2. Nas praças onde funcionarem as agências bancárias, nas quais os cotistas mantiverem suas contas correntes, aplicações, resgates e liquidações de resgates serão processados normalmente.



5. ENCARGOS

Constituem encargos do FUNDO as seguintes despesas, que lhe são debitadas diretamente: (i) taxas, impostos e contribuições que recaiam ou venham a recair sobre os bens, direitos e obrigações do FUNDO; (ii) despesas com o registro de documentos em cartório, impressão, expedição e publicação de relatórios e informações periódicas previstas na regulamentação vigente; (iii) despesas com correspondências de interesse do FUNDO, inclusive comunicações aos cotistas; (iv) honorários e despesas do auditor independente; (v) emolumentos e comissões pagas por operações do FUNDO; (vi) honorários advocatícios, custas e despesas processuais correlatas, incorridas na defesa dos interesses do FUNDO, em juízo ou fora dele, inclusive o valor de eventual condenação; (vii) parcela de prejuízos não cobertos por seguros e não decorrentes diretamente de culpa ou dolo dos prestadores de serviços, no exercício de suas respectivas funções; (viii) despesas relacionadas, direta ou indiretamente, ao exercício do direito de voto decorrente de ativos financeiros do FUNDO; (ix) despesas com liquidação, registro e custódia (caso esta não esteja incluída na taxa de administração do FUNDO) de operações com títulos e valores mobiliários, ativos financeiros e modalidades operacionais integrantes da carteira do FUNDO; (x) despesas com fechamento de câmbio, vinculadas às suas operações ou com certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários; (xi) no caso de fundo fechado, a contribuição anual devida às Bolsas de valores ou às entidades do mercado organizado em que o FUNDO tenha suas cotas admitidas à negociação, se for o caso; (xii) as taxas de administração e performance, se houver; (xiii) os montantes devidos aos fundos investidores em decorrência de acordos de remuneração, que serão deduzidos da taxa de administração e performance, quando aplicável; e (xiv) honorários e despesas relacionadas à atividade de formador de mercado, se for o caso.

5.1. Quaisquer despesas não previstas como encargos do FUNDO correm por conta do ADMINISTRADOR, devendo ser por ele contratadas.

6. POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO DE RESULTADOS

Os resultados do FUNDO serão automaticamente incorporados ao seu patrimônio.

7. ASSEMBLEIA GERAL

Os cotistas serão convocados: (i) anualmente, até 120 (cento e vinte) dias após o encerramento do exercício social, para deliberação sobre as demonstrações contábeis ou (ii) extraordinariamente, sempre que necessário.

7.1. As assembleias gerais obedecerão as seguintes regras: (i) serão convocadas conforme o(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste regulamento, com antecedência mínima de 10 (dez) dias, dispensada esta formalidade se houver presença total; (ii) serão instaladas com qualquer número de cotistas; (iii) as deliberações serão tomadas por maioria de votos, cabendo 1 (um) voto para cada cota; (iv) poderão votar os cotistas, seus representantes legais ou procuradores constituídos há menos de 1 (um) ano; (v) os cotistas poderão enviar seu voto por meio de comunicação física ou eletrônica, desde que a convocação indique essa possibilidade e estabeleça os critérios para essa forma de voto, que não exclui a realização da reunião de cotistas, no local e horário estabelecidos, cujas deliberações serão tomadas pelos votos dos presentes e dos recebidos pelo(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste regulamento, quando assim admitido na convocação; (vi) a critério do ADMINISTRADOR, que definirá os procedimentos a serem seguidos, as deliberações da assembleia serão tomadas por meio de consulta formal, sem reunião de cotistas, em que a) os cotistas manifestarão seus votos, conforme instruções previstas na convocação e b) as decisões serão tomadas com base na maioria dos votos recebidos.

7.1.1. Na hipótese prevista no inciso (v) acima, no caso de não comparecimento físico de cotistas, a assembleia será instalada, sendo a presença dos cotistas caracterizada pelos votos encaminhados antes da realização da assembleia.

7.1.2. Caso a convocação preveja a realização da assembleia por meio eletrônico, os votos dos cotistas relativamente às suas deliberações em assembleia geral deverão ser proferidos mediante a utilização de assinatura eletrônica legalmente reconhecida, sob pena de recusa pelo ADMINISTRADOR.

7.1.3. Na hipótese da não instalação da assembleia geral para deliberação relativa às demonstrações contábeis do FUNDO, em decorrência do não comparecimento de quaisquer cotistas, serão consideradas automaticamente aprovadas caso as demonstrações contábeis não contenham ressalvas.

7.2. O ADMINISTRADOR disponibilizará resumo das deliberações da assembleia geral aos cotistas, em até 30 (trinta) dias após a sua realização, conforme o(s) meio(s) de comunicação estabelecido(s) em capítulo específico deste regulamento, o qual também poderá ser encaminhado juntamente com o extrato.

Os atos ou fatos relevantes que possam influenciar, as decisões de adquirir, alienar ou manter cotas do FUNDO serão imediatamente divulgados aos cotistas por correspondência eletrônica ou outra forma de comunicação disponibilizada pelo ADMINISTRADOR, conforme cláusula específica do regulamento.



9. MEIOS DE COMUNICAÇÃO

O FUNDO utilizará meios físicos ou eletrônicos de comunicação relativamente às suas informações, inclusive no que diz respeito às convocações, deliberações e resumo das assembleias gerais. Nesse sentido, todas as informações ou documentos serão disponibilizados aos cotistas, pelo ADMINISTRADOR, por meio de (i) disponibilização, no endereço eletrônico do ADMINISTRADOR (constante do Formulário de Informações Complementares do FUNDO); (ii) envio de correspondência física; ou (iii) adoção de outra forma de disponibilização, a critério do ADMINISTRADOR, nos termos da regulamentação em vigor. Na hipótese de envio, pelo ADMINISTRADOR, de correspondência física para o endereço de cadastro do cotista, os custos decorrentes deste envio serão suportados pelo FUNDO.

10. FORO

Fica eleito o Foro do domicílio ou da sede do cotista, salvo se o domicílio ou sede do cotista não se situar em território brasileiro, caso em que fica eleito o foro da Capital do Estado de São Paulo.

Para mais informações sobre o FUNDO, consulte o Formulário de Informações Complementares e a Lâmina.

São Paulo - SP, 07 de maio de 2018.

Consultoria e informações sobre investimentos, fale com o seu gerente ou entre em contato com o Investfone 4004-4828 (capitais e regiões metropolitanas) ou 0800 970 4828 (demais localidades). Para dúvidas, sugestões e reclamações, se necessário, utilize o SAC Itaú 0800 728 0728, todos os dias, 24h, ou o Fale Conosco (www.italu.com.br). Se desejar a reavaliação da solução apresentada após utilizar esses canais, recorra à Ouvidoria Corporativa Itaú Unibanco 0800 570 0011, dias úteis, das 9 às 18h, Caixa Postal nº 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala 0800 722 1722, disponível 24h todos os dias.

ANEXO I – DESCRIÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

Fl. 348
192

LIMITES POR ATIVO

(% do patrimônio do FUNDO)

Legislação			Fundo	Descrição dos Ativos Financeiros
GRUPO I – No mínimo 95%	Até 100%		Permitido	FI e FIC registrados com base na Instrução CVM 555/14, classificados como Ações.
	Até 100%		Permitido	Cotas de fundos de investimento em índices de ações <u>constituídos no Brasil</u> (Fundos de Índice de Ações).
	Até 20%	Até 20%	Vedado	FI e FIC registrados com base na Instrução CVM 555/14, destinados a investidores qualificados e classificados como Ações.
		Até 5%	Vedado	FI e FIC registrados com base na Instrução CVM 555/14, destinados a investidores profissionais e classificados como Ações.
	Até 20%		Vedado	<u>Investimento no Exterior</u> : ativos no exterior detidos de forma indireta e consolidada, por meio da aquisição de cotas de fundos de investimento constituídos no Brasil que invistam no exterior, <u>além de cotas de fundos de índice referenciados em índices estrangeiros e cotas de fundos de investimento registrado com base na Instrução CVM 555/14 que possuam em sua denominação o sufixo “Investimento no Exterior”, desde que compatíveis com a política do FUNDO e observada a regulamentação em vigor e as disposições deste Regulamento.</u>
GRUPO II – Até 5%			Permitido	Títulos públicos federais.
			Permitido	Títulos de renda fixa de emissão de instituições financeiras.
			Permitido	Operações compromissadas.
			Permitido	Cotas de fundos de investimento em índices de Renda Fixa (Fundos de Índice).
			Permitido	Cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa em suas modalidades: Curto Prazo, Simples e Referenciado (DI ou Selic)*.

*Este limite será consolidado com os investimentos em cotas de FI e FIC destinados a investidores qualificados e/ou profissionais, indicado no Grupo I. Se o Grupo I vedar o investimento em cotas de FI e FIC destinados a investidores qualificados e/ou profissionais, tal investimento também será vedado para as cotas de FI e FIC previstas no Grupo II.

LIMITES POR EMISSOR

(% do patrimônio do FUNDO)

Legislação	Fundo	Emissor
Até 100%	Permitido	Fundo de investimento
Até 5%	Permitido	Instituição financeira autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil
	Vedado	Companhia aberta
	Vedado	Pessoa física ou jurídica de direito privado que não seja companhia aberta ou instituição financeira autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil

Este FUNDO pode estar exposto, direta ou indiretamente, a significativa concentração em ativos financeiros de renda variável de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.

DERIVATIVOS

Hedge e posicionamento Limitado a uma vez o patrimônio

Este FUNDO poderá aplicar em fundos de investimento que utilizam estratégias com derivativos como parte integrante de suas respectivas políticas de investimento.

OPERAÇÕES COM O ADMINISTRADOR, GESTOR E LIGADAS
(% do patrimônio do FUNDO)

Até 100%	Contraparte ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas, inclusive veículos de investimento por eles administrados ou geridos.
Até 5%	Ativos financeiros de renda fixa emitidos pelo ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas.
Até 100%	Cotas de fundos de investimento administrados pelo ADMINISTRADOR, GESTOR e ligadas.

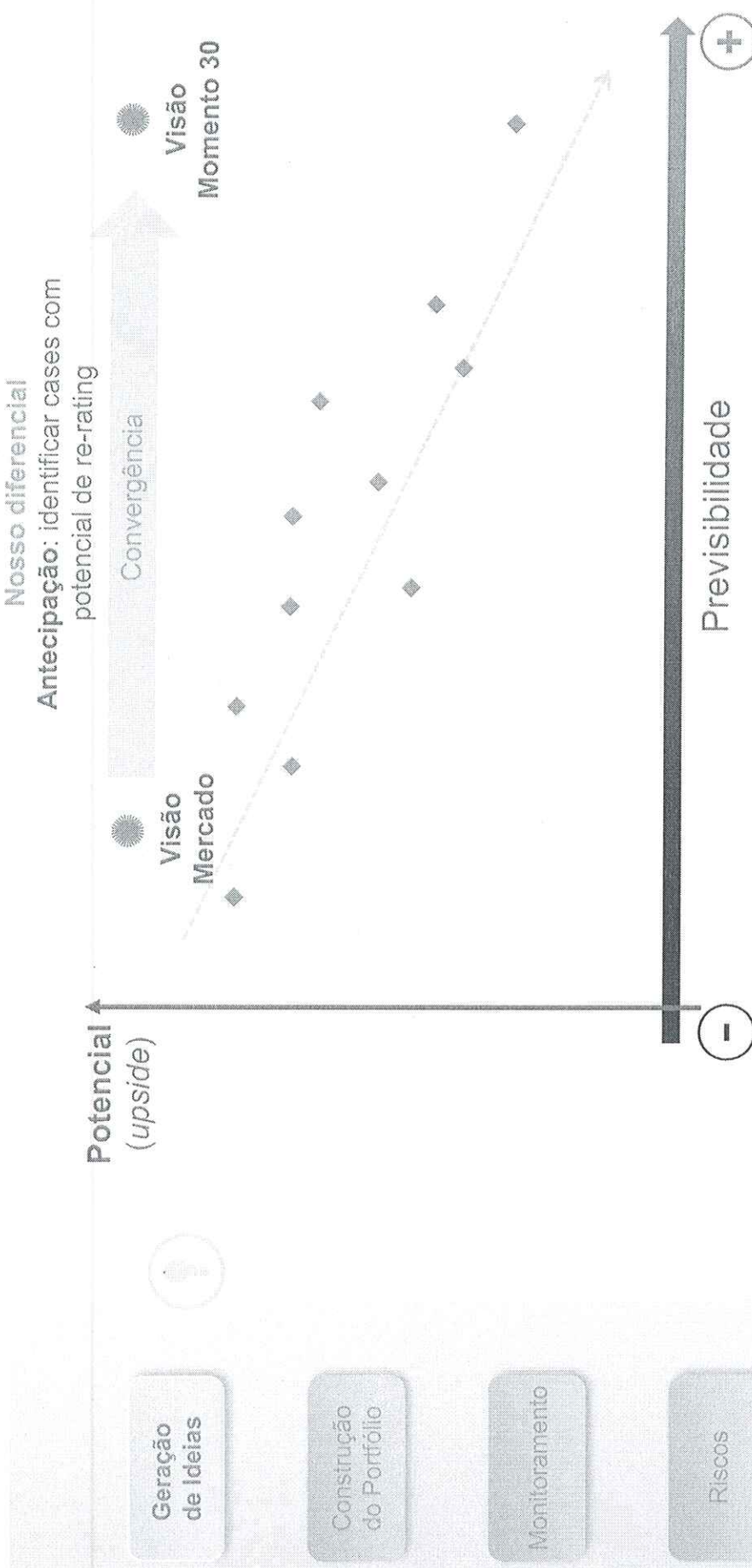
Itaú Ações Momento 30 FICFI

Informação Confidencial – Política Corporativa de Segurança da Informação



Estratégia Unconstrained

Itaú Ações Momento 30 FICFI

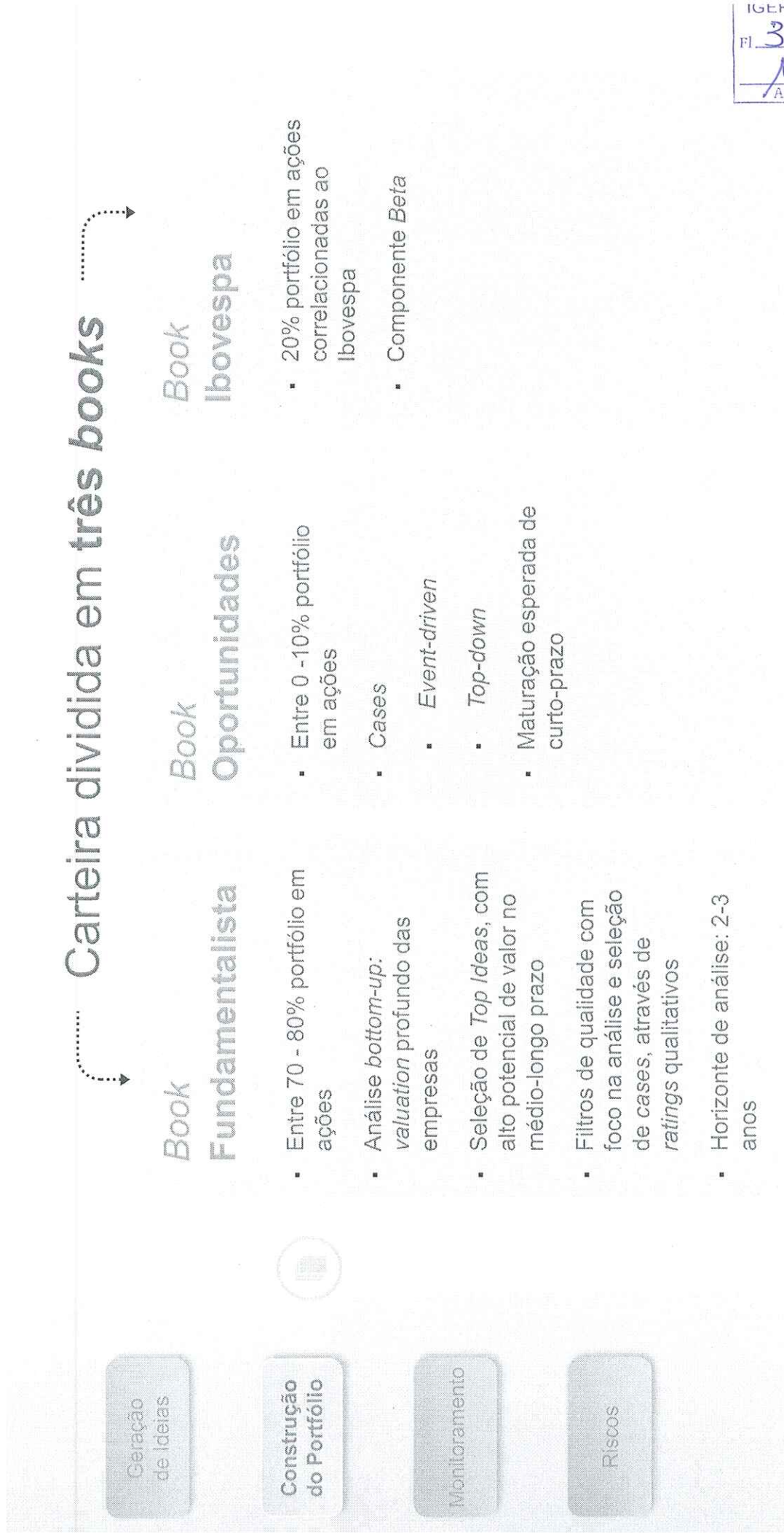


Upside mínimo: derivada da análise macro. Atualmente, 20% em 12 meses, para cases de longo-prazo. Cases de curto-prazo obedecem o mesmo nível de upside esperado, porém ajustado para o horizonte de investimento previsto.



Estratégia Unconstrained

Itaú Ações Momento 30 FICFI



Estratégia Unconstrained

Itaú Ações Momento 30 FICFI



Book Fundamentalista

Renda Variável Brasil:
+200 ações listadas

Filtro de Liquidez:

Análise do volume médio de negociação nas janelas de 3, 6, 12 meses.

Filtro Qualitativo (Ratings):

Análise da Indústria, Positioning, Management, Governança Corporativa, Financials, Balance Sheet, Valuation*

Universo de análise
~150 ações

Nível de Cobertura: Superficial, análise de balanço e acompanhamento informações.

Análise Detalhada:

Análise precisa do balanço da empresa e valuation detalhado (DCF ou Múltiplos)

Teses de Investimentos
~100 ações

Nível de Cobertura: Alto. Contato próximo com o management das empresas, visitas e acompanhamento dos calls de resultado.

Filtros Finais:

Análise de Desempenho: Ações com as melhores avaliações (maior peso)

Dimensionamento
do Portfolio

Liquidez: dimensionamento do tamanho da posição (ajustes pontuais)

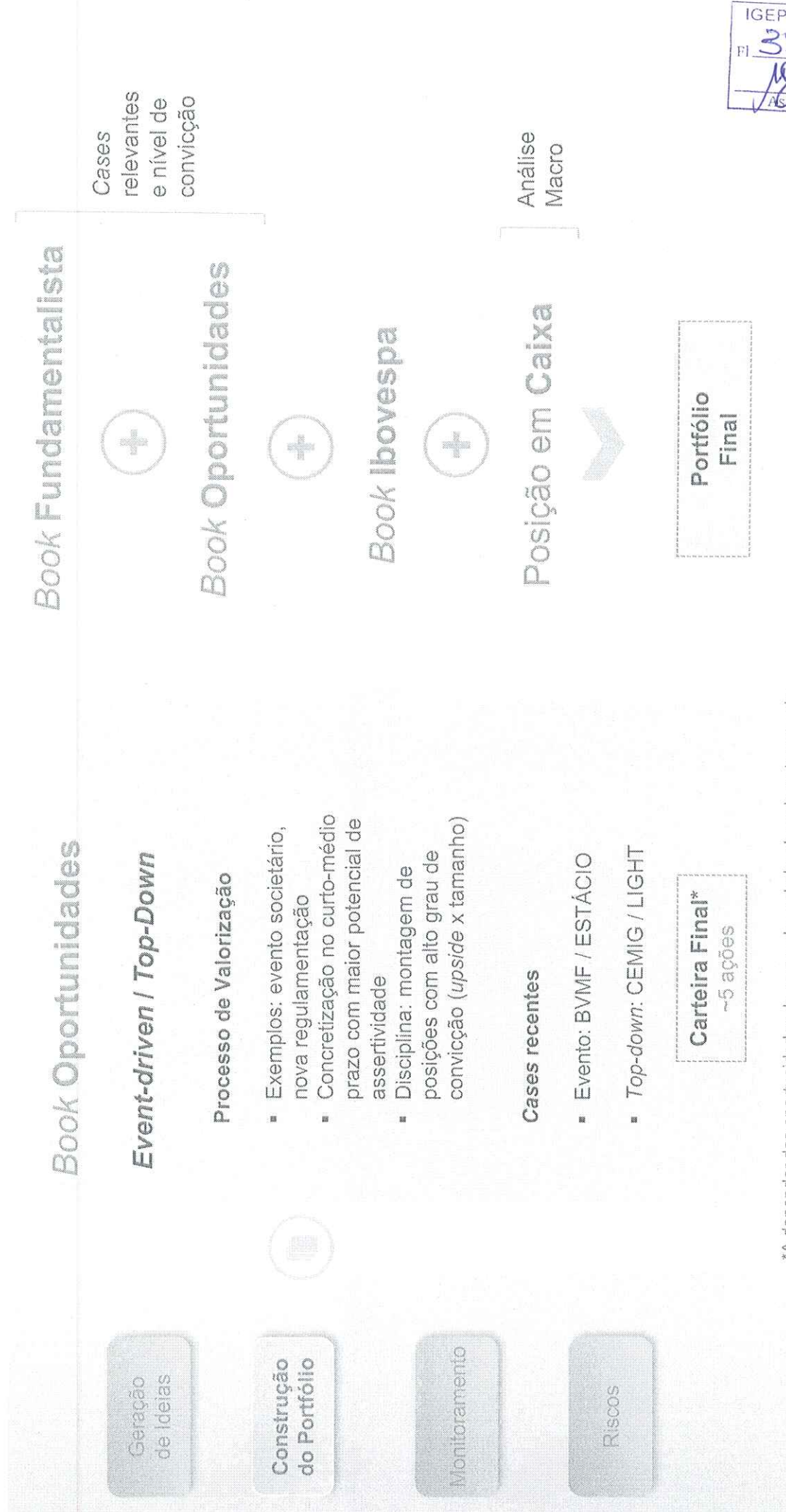
Carteira Final
~20 ações

*Detalhes sobre este processo no anexo



Estratégia Unconstrained

Itaú Ações Momento 30 FICFI



*A depender das oportunidades de mercado, este book pode estar zerado



Estratégia Unconstrained

Itaú Ações Momento 30 FICFI



Geração
de Ideias

Construção
do Portfólio

Monitoramento

Riscos

Gestão de Risco

Gerencial:

A gestão de risco se dá principalmente na “partida”: montagem das posições

- Análise de volatilidade x liquidez x tamanho da posição
- Análise de Risco ex-Ante
- Monitoramento de exposição por papel



Itaú Ações Momento 30 FICFI



	Razão Social Itaú Ações Momento 30 FICFI CNPJ: 16.718.302/0001-30 Início de Fundo: 31/10/2012		Classificação CVM Ações Classificação ANBIMA Ações Livre
	Benchmark IBOVESPA Fechamento		Valores Mínimos Aplicação Inicial R\$ 50.000,00 Aplicação Adicional R\$ 250,00 Saldo Mínimo R\$ 250,00
	Gestor Itaú Unibanco S.A. Administrador Itaú Unibanco S.A.		Horário para Movimentação Até às 16:00 h
	Taxas Taxa de Administração: 2,50% a.a. Taxa de Performance: 20% sobre o que exceder o Ibovespa Fechamento		Legislação Aplicável: Instrução CVM n° 555
	Cotização e Liquidação Financeira* Cota de Aplicação D+0 Cota de Resgate D+21 Crédito do Resgate D+24 *Dias Úteis		Público Alvo Público em Geral





Anexos

Os ratings ou notas são calculados através da média ponderada dos itens abaixo, que são divididos em 4 grupos. As notas variam de 1 a 5 e os pesos podem ser revisados ao longo do tempo para refletir mudanças no mercado

- **Indústria (15%)**: atratividade da indústria (crescimento, resiliência, etc)
- **Positioning (15%)**: posicionamento da empresa dentro da indústria
- **Management (5%)**: qualidade do *management*
- **Governança Corporativa (5%)**: nível de governança
- **Financials (15%)**: nível e consistência de margens e lucratividade
- **Balance Sheet (15%)**: nível e consistência de alavancagem e retorno
- **Valuation (30%)**: múltiplos, DCF, *upside*.

O peso do grupo *valuation* não pode ser superior à soma dos pesos de dois dos outros grupos, com o intuito de evitarmos o *valuation trap* (papéis que estão baratos e continuarão baratos). Essa disciplina nos ajuda a dar sustentabilidade no retorno a longo prazo

Informações relevantes



ITAÚ ACOES MOMENTO 30 FICFI - CNPJ 16.718.302/0001-30

Este fundo possui lâmina de informações essenciais, podendo esta ser consultada no seguinte endereço eletrônico www.itaú.com.br. No resgate de cotas do fundo será utilizado o valor da cota em vigor no 21º dia útil da solicitação de resgate (D+ 21). O pagamento do resgate de cotas do fundo será efetivado no 24º dia útil da solicitação de resgate (D+ 24). As estratégias de investimento do fundo podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento, pessoas físicas e/ou jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A. O índice utilizado trata-se de mera referência econômica e não meta ou parâmetro de performance. Tipo ANBIMA: AÇÕES VALOR/CRESCIMENTO. Descrição do tipo ANBIMA disponível no Formulário de Informações Complementares.

PL Médio 12 Meses (R\$) R\$ 451.798.081,19

Data de início do fundo

31/10/2012

Taxa de adm. ao ano

2,50%

Taxa de Performance

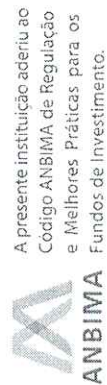
20% que exceder 100% do Ibovespa

Rentabilidade	Dezembro	2018	12 Meses
Fundo	2,35%	24,35%	24,35%
Benchmark Ibovespa	-1,81%	15,03%	15,03%

Fonte: Itaú Asset Management, dados até 31/12/2018

Material de divulgação do fundo.

A Itaú Asset Management é o segmento do Itaú Unibanco especializado em gestão de recursos de clientes. Leia o prospecto, o formulário de informações complementares, lâmina de informações essenciais e o regulamento antes de investir. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito – FGC. Para obter mais informações, entre em contato pelo telefone (11) 3631-2555. Consultas, sugestões, reclamações, críticas, elogios e denúncias, utilize o SAC: 0800 728 0728, todos os dias, 24 horas, ou o canal Fale Conosco (www.itaú.com.br). Se necessário contate a Ouvidoria Corporativa Itaú: 0800 570 0011 (em dias úteis das 9h às 18h) ou Caixa Postal 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, todos os dias, 24 horas, 0800 722 1722.



PARECER DINVEST Nº 09/2020

CREDENCIAMENTO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

NOME DO FUNDO:	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI
CNPJ nº	16.718.302/0001-30
OBJETIVO:	Credenciamento
PROCESSO Nº	2018/24830/2656

Análise da Documentação

A partir da análise dos documentos apresentados pelo gestor e consulta às instituições reguladoras a Diretoria de Investimentos do Igeprev-TO (DINVEST), conclui os seguintes pontos quanto ao Fundo de Investimento:

1- Prestadores de serviço:

1.1. Administrador

Nome: ITAÚ UNIBANCO S.A.
Status: Credenciado
Nr. Processo: 2018/24830/002656

CNPJ: 60.701.190/0001-04
Vigência: 09/06/2020

1.2. Gestor

Nome: ITAÚ UNIBANCO S.A.
Status: Credenciado
Nr. Processo: 2018/24830/002656

CNPJ: 60.701.190/0001-04
Vigência: 09/06/2020

1.3. Distribuidor: ITAÚ UNIBANCO S.A., exclusivamente através de sua rede de agências.

1.4. Custodiante: ITAÚ UNIBANCO S.A.

1.5. Auditor Independente: Ernst & Young Auditores

1.6. Segmento de Mercado: Fundo de Renda Variável

2- Fundo consta da lista de fundos vedados? Não. Consulta em 20/02/2020.

3- Documentos analisados: QDD, Lâmina, Regulamento, Carteira CVM.

3.1. Data de abertura / idade do fundo: 31/10/2012 – 7 anos

3.2. Objetivo do fundo: O objetivo do FUNDO é 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.

3.3. Público alvo: O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A.

3.4. Tipo de condomínio: Aberto.

3.5. Quantidade de cotistas: 29,9 mil

3.6. Benchmark: Ibovespa

3.7. Política de investimento: O objetivo do FUNDO é 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.

3.8. Principais categorias de ativos e fundos: O fundo adquire cotas dos respectivos fundos:

Itaú Caixa Ações FI:

Quantidade de cotas: 34.154,16989

Itaú Ações momento 30:

Quantidade de cotas: 7.779.138,55912

3.9. Patrimônio Líquido: R\$ 1.641.403.118,06 (18/02/2019 - CVM)

3.10. Aplicação mínima: R\$ 5.000,00

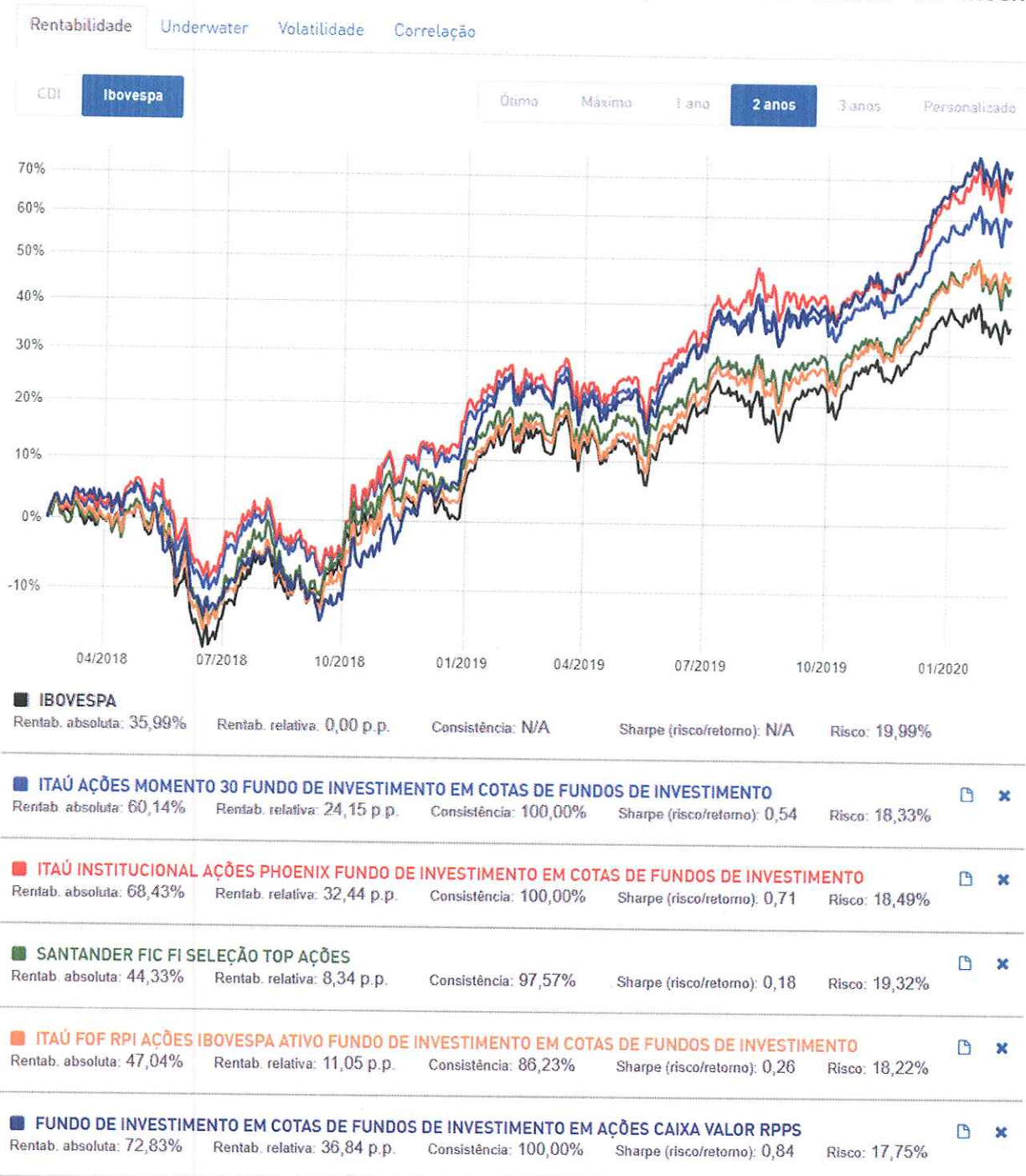
3.11. Pagamento do resgate: D+23 dias úteis contados da data do pedido de resgate.

3.12. Taxas:

Entrada/Saída: 0% **Administração:** 2,5% a.a. **Gestão:** Não Informado
Custódia: Não há. **Performance:** 20% da rentabilidade do fundo que exceder a 100% da variação do Ibovespa.

4- Rentabilidade:

Ao avaliarmos a rentabilidade do Fundo Itaú Ações Momento 30 FIC FI, observa-se que o fundo tem superado a variação do Índice Ibovespa, apresentando relevante consistência e ótimos rendimentos. Quando comparado aos fundos do mesmo



segmento que compõem a carteira do Igeprev-to, o fundo é superado apenas pelos fundos Caixa Ações Valos RPPS e Itaú Ações Phoenix, isto posto, a Dininvest conclui

que o Fundo Itaú Ações Momento 30 FIC FI corresponde a um excelente fundo de ações e opta pelo credenciamento para uma posterior possibilidade de aplicação.

5- Conclusão da análise

Trata-se de credenciamento de fundo de investimento em atendimento ao que dispõe a Resolução CMN 3.922/10 e Resolução 519/11 do Ministério de Previdência Social.

Conforme observado no Questionário *Due Diligence* – QDD Anexo 1 apresentado pela gestora, bem como na Lâmina e Regulamento do fundo consultado na página da Comissão de Valores Mobiliários – CVM, o fundo possui bons resultados de rentabilidade/risco.

Acrescenta-se, ainda, que uma aplicação no fundo atende às indicações de cenários avaliados para o exercício de 2020.

Isto posto, recomenda-se o envio dos autos ao Comitê de Investimentos para deliberação quanto deferimento do credenciamento do novo fundo.

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIÁRIA DO ESTADO DO TOCANTINS, em Palmas, 20 dias do mês de fevereiro do ano de 2020.

(assinado eletronicamente)

VICTOR BARROS PREHL

Gerente de Gestão de Carteira e Aplicações Financeiras

(assinado eletronicamente)

JÚLIO CÉSAR MEDEIROS LIMA

Gerente de Controle e Análise de Risco

(assinado eletronicamente)

REYNALDO FERREIRA DE MELO

Diretor de Investimentos



SGD nº 2020/24839/005142

PROCESSO Nº: 2018/24830/002656
INTERESSADO: ITAÚ UNIBANCO S.A.
CNPJ nº: 60.701.190/0001-04
ASSUNTO: Credenciamento

DESPACHO Nº 010/2020/DINVEST

Retornem-se os autos ao Comitê de Investimentos para análise e deliberação, quanto ao credenciamento dos novos fundos **Itaú Ações Dunamis FIC FI**, **Itaú RF IMA-B Ativo FIC FI** e **Itaú Ações Momento 30 FIC FI** do gestor Itaú Unibanco S.A.

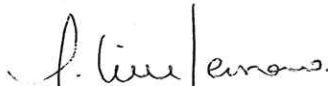
DIRETORIA DE INVESTIMENTOS, aos 20 dias do mês de fevereiro de 2020.

(assinado eletronicamente)
REYNALDO FERREIRA DE MELO
Diretor de Investimentos



ATA DA 2ª ORDINÁRIA REUNIÃO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – 2020

- I. DATA E HORA:** 21 de fevereiro de 2020, às 10h.
- II. LOCAL:** Sala de Reuniões do Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Tocantins – IGEPREV-TOCANTINS.
- III. PRESENÇA:** **Membros do Comitê:** Milene Martins Ramos, Economista e Coordenadora do Comitê de Investimentos; Elenora Antônia de Carvalho, Assistente Administrativa e **Júlio César Medeiros Lima**, Gerente de Controle e Análise de Risco. **Convidado:** Victor Barros Prehl, Gerente de Carteira e Operações Financeiras.
- IV. ORDEM DO DIA:** 1) *Credenciamento de instituições financeiras:*
- V. PARECER DO COMITÊ:** (1) *Credenciamento de instituições financeiras:* A reunião teve início com a apresentação do processo nº 2019/24830/004061, que trata de credenciamento da XP Gestão de Recursos LTDA, com os Fundos XP LONG SHORT 60 FI EM COTAS DE FI MULTIMERCADO, XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP, XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO e XP AÇÕES FIC AÇÕES. Após análise e discussão do processo o Comitê deliberou pela aprovação do credenciamento da instituição. Na sequência houve a apresentação dos Fundos Itaú Ações Momento 30 FIC FI, Itaú Renda Fixa IMA-B Ativo FIC FI e Itaú Ações Dunamis FIC FI, incluídos no processo de credenciamento 2018/24830/002656. Após análise e discussão dos Fundos o Comitê deliberou pela aprovação do credenciamento das instituições.
- VI. ENCERRAMENTO:** A 2ª reunião ordinária do Comitê de Investimentos foi suspensa, devendo ser retomada para continuação da deliberação dos demais processos de credenciamento de instituições financeiras, sendo esta Ata transcrita, lida, aprovada e assinada por todos os presentes.


Milene Martins Ramos

Coordenadora do Comitê de Investimentos


Júlio César Medeiros Lima
Gerente de Controle e Análise de Risco


Elenora Antônia de Carvalho
Assistente Administrativa



SGD: 2020/24839/010005

DESPACHO Nº 01129/2020/GABPRES

O Presidente do Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Tocantins, no uso de suas atribuições e consoante o disposto no Edital de Credenciamento nº 001/2019, de 25 de Outubro de 2019, publicado no *site* do Instituto,

CONSIDERANDO o disposto nos **Pareceres DINVEST** nºs 011/2020 de 06/12/2019, 013/2019 de 20/12/2019 e 009/2020 de 20/02/2020, constante no **Processo nº 2018/24830/002656** do **ITAÚ UNIBANCO S.A.**, que atesta a regularidade da documentação dos fundos apresentados pelo interessado;

CONSIDERANDO o disposto na **Ata da 2ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos** de 21 de fevereiro de 2020, que aprovou o credenciamento dos fundos, que estão em conformidade com a Política de Investimentos de 2020 do Instituto;

RESOLVE:

HOMOLOGAR o credenciamento dos fundos novos apresentados pelo **ITAÚ UNIBANCO S.A.**, como **Gestor de Fundos de Investimentos**, com os fundos: **Itaú Ações Momento 30 FIC FI**, CNPJ nº 16.718.302/0001-30; **Itaú RF IMA-B Ativo FIC FI**, CNPJ nº 05.073.656/0001-58; e, **Itaú Ações Dunamis FIC FI**, CNPJ nº 24.571.922/0001-75.

GABINETE DO PRESIDENTE DO INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIÁRIA DO ESTADO DO TOCANTINS, aos 23 dias do mês de abril de 2020.

(assinado eletronicamente)
SHARLLES FERNANDO BEZERRA LIMA
Presidente

