

CADASTRO DE FUNDO/CLASSE DE INVESTIMENTO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 11.447.136/0001-60 - Claritas Crédito Privado Renda Fixa

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7, V, b

Data do Termo: 31/10/2024

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

INSTITUIÇÕES

Administrador: 59.281.253/0001-23 - BTG Pactual DTVM

Gestor: 03.987.891/0001-00 - Claritas

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

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Data de Início: 04/05/2010

Índice de Referência: CDI

Carência: Não há

Prazo de Resgate: D+0

Categoria de Investidor: Geral

O Fundo/Classe possui Subclasse: Não

Taxa de Administração: 0,50%

Taxa de Performance: 15% exc CDI

Investe em cotas de outros fundos: Não

Possui ativos de Emissores Privados: Sim

Sim - Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira

Não - Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registradas na CVM

Não - Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)

Não - Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC

Não - Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito

Obs.: Informações referentes à 31/05/2024.

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

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

O Fundo tem por objetivo buscar retorno em ativos de renda fixa, admitindo-se estratégias com risco de juros e de índice de preços, integrando, inclusive, questões ASG por meio da aplicação em ativos com boas práticas Ambientais, Sociais e de Governança ("ASG").

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

O fundo possui liquidez em D+0.

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

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

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

O fundo objeto da análise foi comparado com 6 outros fundos, de mesmo benchmark (CDI) e enquadramento (7, V, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,50%, ficou abaixo da média de 0,53% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 12,81%, performou abaixo da média de 13,51%. Base de comparação:

35.648.999/0001-64 - SPX FIC Seahawk Advisory Crédito Privado - Tx Adm: 0,60 - Rent 12M: 14,52

14.171.644/0001-57 - BTG FIC Corporativo I Crédito Privado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 13,87

19.782.311/0001-88 - AZ Quest FIC Valore Crédito Privado - Tx Adm: 1,00 - Rent 12M: 13,68

06.866.051/0001-87 - BV Institucional Crédito Privado Renda Fixa - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 13,10

22.344.843/0001-48 - Butiá FIC TOP Crédito Privado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 13,06

10.783.480/0001-68 - Daycoval Classic Crédito Privado - Tx Adm: 0,35 - Rent 12M: 12,85

Obs.: Rentabilidades com data de fechamento 30/09/2024.

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

O Fundo deverá manter, no mínimo, 80% (oitenta por cento) da carteira em ativos relacionados diretamente, ou sintetizado via derivativos, a exposição de riscos de crédito privado, ao risco de juros do mercado doméstico ou risco de índices de preço, excluindo estratégias que impliquem em risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

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

O fundo não possui carência para resgate. Sua liquidez no resgate é D+31.

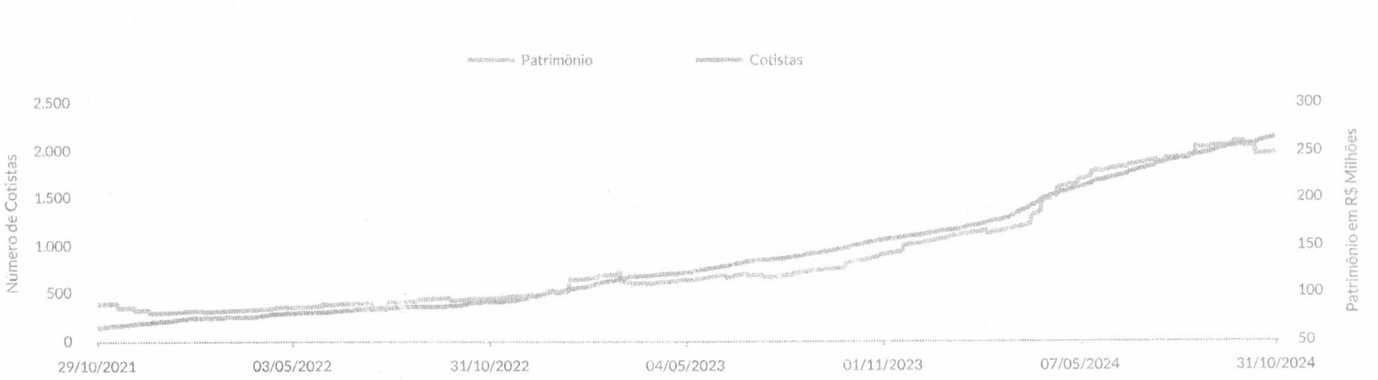
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foi observado 1 fundo da gestora 03.987.891/0001-00, enquadrado para RPPS, em uma janela de 12 meses: 11.357.735/0001-93. Em matéria de performance, o fundo ficou abaixo do benchmark.

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

Não se aplica

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	249.391.956,12	2154
Médio em 12 meses	206.627.321,55	1593
Médio em 24 meses	161.560.648,34	1166

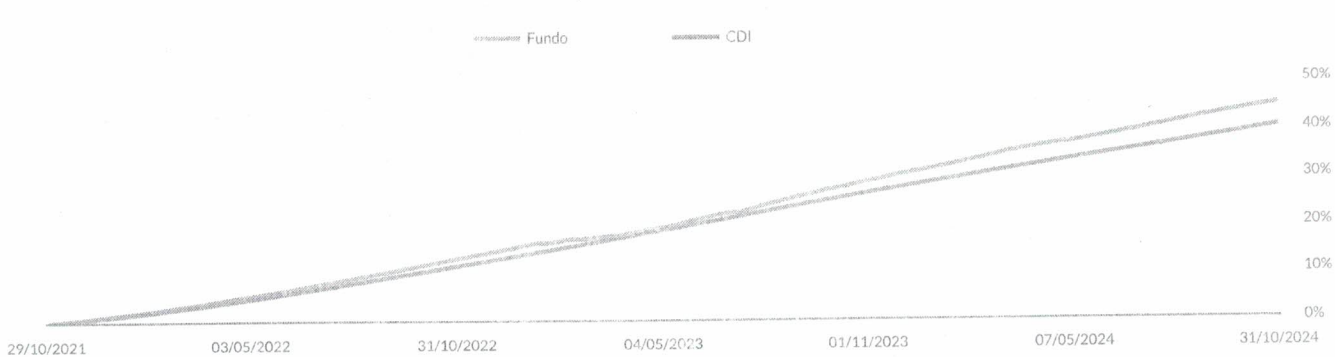
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,78	0,89	1,05	0,92	1,10	1,22	1,13	1,30	1,26	1,18	1,16	1,24	14,06
CDI	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	1,17	1,07	1,02	1,02	1,12	12,37
% CDI	106,94	118,22	113,42	109,98	106,58	120,50	109,51	111,76	117,63	115,25	113,78	110,56	113,67

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,83	0,44	0,80	0,92	1,40	1,24	1,16	1,55	1,25	1,16	1,15	0,94	13,60
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	13,05
% CDI	73,58	48,23	67,92	99,75	124,66	115,57	108,31	135,73	128,49	116,49	124,98	104,33	104,25

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,23	1,06	0,99	0,76	0,91	0,92	1,13	0,97	0,91				10,17
CDI	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91	0,87	0,83				7,99
% CDI	126,79	131,57	118,97	85,23	109,29	116,30	124,31	112,34	109,09				127,26

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Debêntures	109.296.889,39	46,14
Operações Compromissadas	51.327.964,54	21,67
Títulos Públicos	38.544.386,76	16,27
Cotas de Fundos	24.311.369,13	10,26
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	13.720.723,89	5,79
Valores a receber	26.474,79	0,01
Valores a pagar	-341.247,29	-0,14

Obs.: Informações referentes à 28/06/2024.

RESPONSÁVEIS PELO CADASTRO

Os responsáveis atestam que:

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

NOME	CPF	ASSINATURA
Junia Donzete da	05080145650	
Amanda Aparecida Braga	088.135.846-01	
Jose Carlos Reis	809.886.546-34	
Magda de Lourdes Faria	712466306-72	
Anne da Cruz F. Machado	243.437.448-00	