
***BV Icatu Seg Platinum
Previdência Multimercado
Crédito Privado Fundo de
Investimento***

(CNPJ nº 08.541.158/0001-80)

***(Administrado pela BV Distribuidora de
Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)***

Demonstrações financeiras em

30 de junho de 2022

e relatório do auditor independente



Relatório do auditor independente sobre as demonstrações financeiras

Aos Cotistas e à Administradora
BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado
Crédito Privado Fundo de Investimento
(Administrado pela BV Distribuidora de
Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Opinião

Examinamos as demonstrações financeiras do BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento ("Fundo"), que compreendem o demonstrativo da composição e diversificação da carteira em 30 de junho de 2022 e a demonstração da evolução do patrimônio líquido para o exercício findo nessa data, bem como as correspondentes notas explicativas, incluindo as políticas contábeis significativas e outras informações elucidativas.

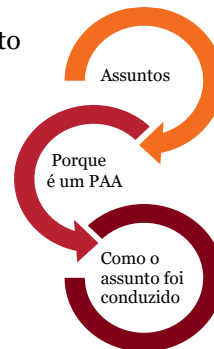
Em nossa opinião, as demonstrações financeiras acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento em 30 de junho de 2022 e o desempenho de suas operações para o exercício findo nessa data, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de investimento regidos pela Instrução CVM nº 555.

Base para opinião

Nossa auditoria foi conduzida de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria. Nossas responsabilidades, em conformidade com tais normas, estão descritas na seção a seguir intitulada "Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras". Somos independentes em relação ao Fundo, de acordo com os princípios éticos relevantes previstos no Código de Ética Profissional do Contador e nas normas profissionais emitidas pelo Conselho Federal de Contabilidade, e cumprimos com as demais responsabilidades éticas conforme essas normas. Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opinião.

Principais Assuntos de Auditoria

Principais Assuntos de Auditoria (PAA) são aqueles que, em nosso julgamento profissional, foram os mais significativos em nossa auditoria do exercício corrente. Esses assuntos foram tratados no contexto de nossa auditoria das demonstrações financeiras como um todo e na formação de nossa opinião sobre essas demonstrações financeiras e, portanto, não expressamos uma opinião separada sobre esses assuntos.





BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado
Crédito Privado Fundo de Investimento
(Administrado pela BV Distribuidora de
Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Porque é um PAA

Como o assunto foi conduzido em nossa auditoria

Precificação e existência dos investimentos

Conforme demonstrativo da composição e diversificação da carteira, os investimentos do Fundo são compostos, substancialmente, por operações compromissadas e por títulos públicos classificados na categoria de títulos para negociação.

Para precificação das operações compromissadas, a apropriação dos rendimentos considera a taxa de remuneração estabelecida na data da contratação.

A precificação dos títulos públicos classificados na categoria de títulos para negociação é apurada com base nos preços de negociação no mercado ativo.

A existência das operações compromissadas e dos títulos públicos é assegurada por meio de conciliações com as informações do órgão custodiante.

Considerando a relevância desses investimentos em relação ao patrimônio líquido do Fundo e a consequente apuração do valor da cota, a precificação e a existência desses investimentos foram consideradas áreas de foco em nossa auditoria.

Nossos principais procedimentos de auditoria consideraram, entre outros:

Obtivemos entendimento dos principais processos relacionados à precificação e existência desses investimentos do Fundo.

Para as operações compromissadas, realizamos em base amostral, o recálculo da apropriação dos rendimentos das operações compromissadas com base na taxa de remuneração estabelecida na data da contratação.

Em base amostral, confrontamos os valores utilizados para a precificação dos títulos públicos classificados na categoria de títulos para negociação, apurados pela administradora do Fundo, com os preços de negociação no mercado ativo.

Testamos a existência das operações compromissadas e dos títulos públicos por meio do confronto das informações constantes na carteira do Fundo com as informações do órgão custodiante.

Nossos procedimentos de auditoria proporcionaram evidência apropriada e suficiente sobre a precificação e a existência desses investimentos do Fundo.

Responsabilidades da administração e da governança pelas demonstrações financeiras

A administração do Fundo é responsável pela elaboração e adequada apresentação das demonstrações financeiras de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de investimento regidos pela Instrução CVM nº 555 e pelos controles internos que ela determinou como necessários para permitir a elaboração de demonstrações financeiras livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro.

Na elaboração das demonstrações financeiras, a administração é responsável pela avaliação da capacidade do Fundo continuar operando, divulgando, quando aplicável, os assuntos relacionados com a sua continuidade operacional e o uso dessa base contábil na elaboração das demonstrações financeiras. A continuidade das operações de um fundo de investimento é, adicionalmente, dependente da prerrogativa dos cotistas em resgatar suas cotas nos termos do regulamento do Fundo.



BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado
Crédito Privado Fundo de Investimento
(Administrado pela BV Distribuidora de
Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Os responsáveis pela governança do Fundo são aqueles com responsabilidade pela supervisão do processo de elaboração das demonstrações financeiras.

Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras

Nossos objetivos são obter segurança razoável de que as demonstrações financeiras, tomadas em conjunto, estão livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro, e emitir relatório de auditoria contendo nossa opinião. Segurança razoável é um alto nível de segurança, mas não uma garantia de que a auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria sempre detectam as eventuais distorções relevantes existentes. As distorções podem ser decorrentes de fraude ou erro e são consideradas relevantes quando, individualmente ou em conjunto, possam influenciar, dentro de uma perspectiva razoável, as decisões econômicas dos usuários tomadas com base nas referidas demonstrações financeiras.

Como parte de uma auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria, exercemos julgamento profissional e mantemos ceticismo profissional ao longo da auditoria. Além disso:

- Identificamos e avaliamos os riscos de distorção relevante nas demonstrações financeiras, independentemente se causada por fraude ou erro, planejamos e executamos procedimentos de auditoria em resposta a tais riscos, bem como obtemos evidência de auditoria apropriada e suficiente para fundamentar nossa opinião. O risco de não detecção de distorção relevante resultante de fraude é maior do que o proveniente de erro, já que a fraude pode envolver o ato de burlar os controles internos, conluio, falsificação, omissão ou representações falsas intencionais.
- Obtemos entendimento dos controles internos relevantes para a auditoria para planejarmos procedimentos de auditoria apropriados às circunstâncias, mas, não, com o objetivo de expressarmos opinião sobre a eficácia dos controles internos do Fundo.
- Avaliamos a adequação das políticas contábeis utilizadas e a razoabilidade das estimativas contábeis e respectivas divulgações feitas pela administração.
- Concluimos sobre a adequação do uso, pela administração, da base contábil de continuidade operacional e, com base nas evidências de auditoria obtidas, se existe incerteza relevante em relação a eventos ou condições que possam levantar dúvida significativa em relação à capacidade de continuidade operacional do Fundo. Se concluirmos que existe incerteza relevante, devemos chamar atenção em nosso relatório de auditoria para as respectivas divulgações nas demonstrações financeiras ou incluir modificação em nossa opinião, se as divulgações forem inadequadas. Nossas conclusões estão fundamentadas nas evidências de auditoria obtidas até a data de nosso relatório. Todavia, eventos ou condições futuras podem levar o Fundo a não mais se manter em continuidade operacional.
- Avaliamos a apresentação geral, a estrutura e o conteúdo das demonstrações financeiras, inclusive as divulgações e se as demonstrações financeiras representam as correspondentes transações e os eventos de maneira compatível com o objetivo de apresentação adequada.

Comunicamo-nos com os responsáveis pela governança a respeito, entre outros aspectos, do alcance e da época dos trabalhos de auditoria planejados e das constatações significativas de auditoria, inclusive as deficiências significativas nos controles internos que, eventualmente, tenham sido identificadas durante nossos trabalhos.



BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado
Crédito Privado Fundo de Investimento
(Administrado pela BV Distribuidora de
Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Dos assuntos que foram objeto de comunicação com os responsáveis pela governança, determinamos aqueles que foram considerados como mais significativos na auditoria das demonstrações financeiras do exercício corrente e que, dessa maneira, constituem os Principais Assuntos de Auditoria. Descrevemos esses assuntos em nosso relatório de auditoria, a menos que lei ou regulamento tenha proibido divulgação pública do assunto, ou quando, em circunstâncias extremamente raras, determinarmos que o assunto não deve ser comunicado em nosso relatório porque as consequências adversas de tal comunicação podem, dentro de uma perspectiva razoável, superar os benefícios da comunicação para o interesse público.

São Paulo, 28 de setembro de 2022

PricewaterhouseCoopers
Auditores Independentes Ltda.
CRC 2SP000160/O-5

DocuSigned by:
Wiliam Shigueaki Tatebe
Assinado por: WILIAN SHIGUEAKI TATEBE:21858637899
CPF: 21858637899
Data/Hora da Assinatura: 28 September 2022 | 17:11 BRT

Wiliam Shigueaki Tatebe
Contador CRC 1SP253071/O-3

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado
Crédito Privado Fundo de Investimento
 (CNPJ nº 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira

em 30 de junho de 2022

(Em milhares de Reais)

Aplicações/especificações	Quantidade	Valor de Mercado/ Realização	% sobre o patrimônio líquido
Disponibilidades		14	0,31
Banco Votorantim S.A. (*)		14	0,31
Operações Compromissadas		656	14,71
Títulos do Tesouro Nacional		656	14,71
Tesouro IPCA+c/ Juros Semestrais (NTN-B)	165	656	14,71
Títulos e valores mobiliários		3.792	85,04
Títulos do Tesouro Nacional		3.792	85,04
Tesouro Selic (LFT)	309	3.654	81,95
Tesouro IPCA+c/ Juros Semestrais (NTN-B)	34	138	3,09
Instrumentos financeiros derivativos		8	0,18
Compra de Futuros	27	8	0,18
Venda de Futuros	2	-	-
Outros Créditos		6	0,13
Dividendos		3	0,07
Despesas antecipadas		3	0,07
Total do ativo		4.476	100,38
Instrumentos financeiros derivativos		4	0,09
Venda de Futuros	12	4	0,09
Outras obrigações		13	0,29
Diversas		13	0,29
Patrimônio líquido		4.459	100,00
Total do passivo		4.476	100,38

(*) Parte relacionada à Administradora/Gestora do Fundo

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações financeiras.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado

Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ nº 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Demonstração da evolução do patrimônio líquido

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais, exceto os valores unitários das cotas)

	2022	2021
Patrimônio líquido no início do exercício		
Representado por 1.683.461 cotas a R\$ 2,672238 cada	4.499	
Representado por 3.354.347 cotas a R\$ 2,653957 cada		8.902
Cotas emitidas		
4.574 cotas	12	
8.693 cotas		23
Cotas resgatadas		
86.718 cotas	(211)	
1.679.579 cotas		(4.057)
Varição no resgate de cotas	<u>(23)</u>	<u>(403)</u>
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício	<u>4.277</u>	<u>4.465</u>
Composição do resultado do exercício		
Ações	<u>(41)</u>	<u>3</u>
Desvalorização/Valorização a preço de mercado	(3)	2
Resultado nas negociações	(64)	-
Dividendos e juros sobre capital próprio	26	1
Renda fixa e outros títulos e valores mobiliários	<u>347</u>	<u>127</u>
Resultado nas negociações	(68)	1
Apropriação de rendimentos	333	160
Resultado de operações compromissadas	34	10
Valorização/Desvalorização a preço de mercado	48	(44)
Demais receitas	<u>1.592</u>	<u>132.657</u>
Outras Receitas	5	11
Ganhos com derivativos	1.587	132.646
Demais despesas	<u>(1.716)</u>	<u>(132.753)</u>
Remuneração da administração	(71)	(93)
Serviços contratados pelo Fundo	(1)	(2)
Auditoria e custódia	(8)	(10)
Publicações e correspondências	(1)	(1)
Taxa de fiscalização CVM	(3)	(6)
Perdas com derivativos	(1.629)	(132.634)
Corretagem e emolumentos	(2)	(7)
Despesas diversas	(1)	-
Resultado do exercício	<u>182</u>	<u>34</u>
Patrimônio líquido no final do exercício		
Representado por 1.601.317 cotas a R\$ 2,784480 cada	<u><u>4.459</u></u>	
Representado por 1.683.461 cotas a R\$ 2,672238 cada		<u><u>4.499</u></u>

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações financeiras.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

1 Contexto operacional

O BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento (“Fundo”) iniciou suas operações em 25 de junho de 2007, constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração e tem como objetivo obter ganhos de capital no longo prazo, que superem a evolução da “Taxa DI”, através da aplicação em ativos que se caracterizem como renda fixa, mercado de juros, índice de preços, câmbio e ações, observadas as limitações impostas pela legislação em vigor.

O Fundo apresenta risco ao investidor, havendo a possibilidade de perdas ao capital investido em função da política de investimento adotada pela Administradora/Gestora ou pelos investimentos do Fundo que, por sua própria natureza, estão sujeitos aos seguintes riscos: de mercado, de crédito, de liquidez, de derivativos e de associados e controles, havendo a possibilidade de aporte de recursos em caso de patrimônio líquido negativo, quando aplicável.

O Fundo destina-se a um único investidor profissional, cujos recursos sejam decorrentes unicamente de reservas técnicas dos Planos Geradores de Benefício Livre (“PGBL’s”) e de Vida Gerador de Benefício Livre (“VGBL’s”), instituídos pela Icatu Seguros S.A.

As aplicações realizadas no Fundo não contam com a garantia da Administradora ou de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos (FGC).

2 Apresentação e elaboração das demonstrações financeiras

As demonstrações financeiras foram elaboradas de acordo com as práticas contábeis aplicáveis aos fundos de investimento, regidos pela Instrução CVM nº 555, complementadas pelas normas previstas no Plano Contábil dos Fundos de Investimento (COFI), e pelas orientações emanadas da Comissão de Valores Mobiliários (CVM).

Na elaboração dessas demonstrações financeiras foram utilizadas premissas e estimativas de preços para a contabilização e determinação dos valores dos ativos integrantes da carteira do Fundo. Dessa forma, quando da efetiva liquidação financeira desses ativos, os resultados auferidos poderão vir a ser diferentes dos estimados.

3 Descrição das principais políticas contábeis

a. Apuração do resultado

As receitas e as despesas são apropriadas de acordo com o regime de competência.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

b. Títulos e valores mobiliários

Os títulos e valores mobiliários são classificados em duas categorias específicas de acordo com a intenção de negociação, atendendo aos seguintes critérios para contabilização:

- i. Títulos para negociação** - incluem os títulos e valores mobiliários adquiridos com o objetivo de serem negociados frequentemente e de forma ativa, sendo contabilizados pelo valor efetivamente pago, acrescidos dos rendimentos intrínsecos e ajustados a valor de mercado, em que as perdas e os ganhos realizados e não realizados sobre esses títulos são reconhecidos no resultado.
- ii. Títulos mantidos até o vencimento** - incluem os títulos e valores mobiliários para os quais haja a intenção e a capacidade financeira para mantê-los até o vencimento, sendo contabilizados ao custo de aquisição, acrescidos dos rendimentos intrínsecos, desde que observadas, cumulativamente, as seguintes condições:
 - O fundo de investimento seja destinado exclusivamente a um único investidor, a investidores pertencentes ao mesmo conglomerado ou grupo econômico-financeiro ou a investidores qualificados, esses últimos definidos como tal pela regulamentação editada pela CVM relativamente aos fundos de investimento;
 - Todos os cotistas devem declarar formalmente, que possuem capacidade financeira para levar ao vencimento os ativos do Fundo classificados nessa categoria e a sua anuência à classificação; e
 - Para o Fundo investir em cotas de outro fundo de investimento, que classifique títulos e valores mobiliários da sua carteira na categoria de títulos mantidos até o vencimento, é necessário que sejam atendidas, pelo cotista do Fundo investidor, as mesmas condições acima mencionadas.

O Fundo não classificou os títulos e valores mobiliários na categoria de mantidos até o vencimento.

c. Operações compromissadas

As operações compromissadas são demonstradas ao valor do principal, acrescido dos rendimentos/despesas auferidos.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

d. Ações

As ações são registradas pelo valor efetivamente pago e ajustados, diariamente, pelo valor de mercado com base na última cotação diária de fechamento, negociados na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão .

e. Dividendos e juros sobre capital próprio

São registradas em receita na ocasião em que as respectivas ações passam a ser negociadas *ex-direito*.

f. Corretagens

As corretagens pagas nas operações efetuadas na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão , são apropriadas ao resultado por ocasião da realização destas.

As corretagens e emolumentos nas operações de compra de ações são incorporadas ao custo de aquisição das ações.

g. Instrumentos financeiros derivativos

As operações com instrumentos financeiros derivativos são registradas da seguinte forma:

i. Na data da operação

Os instrumentos financeiros derivativos são registrados em contas de ativo ou passivo de acordo com as características do contrato.

ii. Diariamente

Ajustados, pelo valor de mercado dessas operações, sendo suas perdas e os seus ganhos reconhecidos diariamente no resultado.

4 Títulos e valores mobiliários

O montante, a natureza, as faixas de vencimento, os valores de custo atualizado (inclui rendimentos auferidos) e os valores de mercado dos títulos e valores mobiliários classificados como títulos para negociação, em 30 de junho de 2022, eram os seguintes:

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

Títulos do Tesouro Nacional	Custo corrigido	Valor de mercado	Vencimento	
			Até 12 meses	Acima de 12 meses
Tesouro Selic (LFT)	3.646	3.654	-	3.654
Tesouro IPCA+ com juros semestrais (NTN-B)	147	138	-	138
Total	3.793	3.792	-	3.792

As metodologias adotadas para definição do valor de mercado visam à atualização dos ativos, integrantes da carteira do Fundo por uma estimativa mais próxima possível dos valores efetivamente praticados no mercado financeiro.

Os valores de emissão dos títulos Tesouro Selic (LFT) foram atualizados pela variação da taxa SELIC média (da data de emissão até 30 de junho de 2022). Os valores apurados foram descontados pela taxa de ágio/deságio, para as respectivas datas de vencimento dos papéis, apuradas no mercado secundário e divulgadas pela ANBIMA.

Os valores de emissão dos títulos Tesouro IPCA+ com juros semestrais (NTN-B) foram atualizados pela variação do IPC-A (da data de emissão até 30 de junho de 2022) e acrescidos dos juros calculados pela taxa dos papéis. Os valores apurados foram descontados pela taxa de ágio/deságio, para as respectivas datas de vencimento dos papéis, apurados no mercado secundário e divulgadas pela ANBIMA.

5 Instrumentos financeiros derivativos

Os critérios de precificação dos instrumentos financeiros derivativos são definidos pela área de gerenciamento de risco da BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. e consideram preços oficialmente divulgados pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais (ANBIMA) e pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão, bem como taxas oficiais de prêmios de opção e outros riscos calculados de acordo com metodologias convencionais e consagradas, adequadas ao tipo de transação. Todas as etapas do processo de precificação seguem procedimentos de controles internos definidos e acompanhados por área específica e independente, bem como pela auditoria interna da BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., que verifica sua adequação frente às normas externas regulamentadas e políticas aplicáveis.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

a. Política de utilização

O Fundo pode efetuar operações que envolvam instrumentos financeiros derivativos, atuando em mercado organizado e de balcão, com o objetivo de possibilitar uma gestão de risco de mercado adequada à política de investimentos, tanto para proteção (“hedge”) de ativos quanto para a montagem de posições direcionais, de acordo com o seu regulamento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em perdas significativas para os cotistas, podendo acarretar inclusive perdas superiores ao capital investido e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do Fundo.

As operações realizadas em mercados derivativos podem ser realizadas tanto naqueles administrados pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão, neste caso, desde que devidamente registradas em sistemas de registro e de liquidação financeira de ativos autorizados pelo Banco Central do Brasil e pela Comissão de Valores Mobiliários.

b. Critérios de avaliação e mensuração do valor de mercado

Futuros

A apuração do valor de mercado das operações no “mercado futuro” é efetuada utilizando os valores referentes aos ajustes diários divulgados diariamente pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

O quadro a seguir resume o valor referencial atualizado e os respectivos valores de ajuste para as operações de futuros:

Futuros	Quantidade	Mercado		Vencimento	
		Valor da posição	Valor do ajuste	Até 12 meses	Acima de 12 meses
Futuro DII – Comprado	25	1.853	7	-	7
Futuro AUS – Comprado	1	36	-	-	-
Futuro GBR – Comprado	1	64	1	1	-
Futuros WDO – Vendido	2	105	(1)	(1)	-
Futuros CAN – Vendido	2	26	-	-	-
Futuros DII – Vendido	10	585	(3)	-	(3)
Total	13	2.669	4	-	4

O valor referencial das operações no mercado futuro registradas em conta de compensação totaliza R\$ 2.669.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

O resultado com operações no mercado futuro no exercício totaliza R\$ (39) (R\$ 42 em 2021).

Opções

As operações com opções de Ibovespa são atualizadas diariamente utilizando-se o modelo Black & Scholes, tomando como base, as volatilidades diárias obtidas de operações efetivas no mercado.

No exercício findo em 30 de junho de 2022 não há saldo em aberto com operações de opções.

O resultado com operações de opções no exercício totalizam R\$ (3) (R\$ (30) em 2021).

c. Valor e tipo de margem em garantia

O quadro a seguir resume os valores depositados em garantia na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão em 30 de junho de 2022:

<u>Títulos</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valor</u>
Tesouro Selic (LFT)	100	1.183
Total	<u>100</u>	<u>1.183</u>

6 Riscos e política de administração de riscos

Os riscos são expressos no regulamento do Fundo e variam conforme a política de investimentos prevista.

O investimento no Fundo apresenta riscos para os investidores. Ainda que o Gestor da carteira mantenha sistema de gerenciamento de riscos, não há garantia de completa eliminação da possibilidade de perdas para o Fundo e para os investidores. Entre os fatores de risco a que o Fundo pode estar sujeito, destacam-se os seguintes:

- **Risco de mercado** - o valor dos ativos que integram a carteira do Fundo pode variar em função de flutuações nas taxas de juros, preços e cotações de mercado. Pelo fato do Fundo manter seus ativos avaliados diariamente a preços de mercado, estas variações podem gerar volatilidade no valor das cotas e perdas aos cotistas do Fundo;
- **Risco de crédito** - consiste no risco de inadimplemento ou atraso no pagamento de juros ou principal pelos emissores dos ativos ou pelas contrapartes das operações do Fundo, podendo

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

ocasionar, conforme o caso, a redução de ganhos ou mesmo perdas financeiras até o valor das operações contratadas e não liquidadas. Estas perdas podem gerar prejuízos ao cotista do Fundo;

- **Risco de liquidez** - consiste no risco de o Fundo não estar apto a efetuar pagamentos relativos aos resgates de cotas solicitados, em função de fatores que acarretam na falta de liquidez nos mercados nos quais os títulos e valores mobiliários integrantes da carteira são negociados, em condições atípicas de mercado e/ou grande volume de solicitações de resgates. Nestes casos, o Fundo permanecerá exposto durante o respectivo período de falta de liquidez, aos riscos associados aos referidos ativos e às posições assumidas em mercados de derivativos, se for o caso, que podem, inclusive, obrigar o Gestor a aceitar deságios nos seus respectivos preços de forma a realizar sua negociação em mercado;
- **Risco de derivativos** - consiste no risco relacionado à utilização de derivativos pelo Fundo. Os instrumentos financeiros derivativos são influenciados pelos preços à vista dos ativos a eles relacionados, pelas expectativas futuras de preços, liquidez dos mercados, além do risco de crédito da contraparte, podendo ocasionar perdas superiores às previstas, quando da realização dessas operações. Mesmo que o Fundo utilize derivativos para proteção das posições a vista, existe o risco da posição não representar um "hedge" perfeito ou suficiente para evitar perdas;
- **Riscos associados e controles** - os procedimentos de avaliação e mensuração dos riscos de mercado, de crédito (risco do emissor não honrar os compromissos de pagamento de juros e principal de suas dívidas) e de liquidez (risco de baixa liquidez acentuar o movimento de preços dos ativos, comprometendo o retorno do Fundo) são previstos em políticas próprias e acompanhados através de sistema de controle adequado. A área de gerenciamento de risco e compliance da BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. é responsável pelo monitoramento diário das exposições de risco e pela sua adequação aos cenários conjunturais traçados pela política de investimentos.

Política de administração de risco

A área de gerenciamento de risco e compliance da BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. é responsável pelo acompanhamento das operações, adotando como procedimentos básicos:

- Monitoramento diário da exposição incorrida de posições e riscos aos limites previstos no regulamento, através da diversificação de ativos e da análise de crédito dos emissores.
- Acompanhamento da correta marcação a mercado de todos os ativos e derivativos do Fundo

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

- Análise de sensibilidade e variações bruscas de mercado, definidas por oscilações historicamente ocorridas e/ou por cenários de "stress".
- Cálculo diário do valor em risco (VaR) com confiança de 95% calculado através da metodologia denominada "risk metrics".

Análise de sensibilidade

O VaR (Value at Risk) é a métrica de risco que informa a perda financeira esperada considerando um horizonte de tempo e um intervalo de confiança determinado. Para o cálculo do VaR, foi adotado o modelo paramétrico (delta-normal), horizonte com janela de 1 dia, matriz de correlação e desvio padrão em intervalo de 126 dias úteis e intervalo de confiança de 95%.

Patrimônio líquido: R\$ 4.459

VaR (Valor em risco): 0,18%

Risco: R\$ 8

7 Emissões e resgates de cotas

a. Emissões

As emissões são processadas com base no valor da cota de fechamento resultante da divisão do valor do patrimônio líquido pelo número de cotas do Fundo, apurados, ambos, no encerramento do dia, assim entendido o horário de fechamento dos mercados em que o Fundo atua.

b. Resgates

Os resgates são processados com base no valor da cota de fechamento apurado no 1º (primeiro) dia útil do recebimento do pedido. O pagamento do resgate será efetuado no 1º (primeiro) dia útil subsequente à data de conversão das cotas.

As cotas do Fundo não estão sujeitas a prazo de carência para efeito de resgate.

8 Taxa de administração

A taxa de administração é paga mensalmente, até o 5º (quinto) dia útil do mês subsequente, e vem sendo provisionada diariamente, por dia útil, sobre o patrimônio líquido do Fundo, a razão de 1,60% ao ano.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

A despesa correspondente à taxa de administração, no montante de R\$ 71 (R\$ 93 em 2021), está apresentada na demonstração da evolução do patrimônio líquido em “Demais despesas - Remuneração da administração”.

O Fundo não cobrará taxa de performance, de ingresso ou de saída.

9 Custódia dos títulos da carteira

Os títulos públicos e as aplicações em operações compromissadas são registradas no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC), as ações, os contratos futuros e as opções são registradas na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

A despesa correspondente a custódia, no montante de R\$ 7 (R\$ 6 em 2021), está apresentada na demonstração da evolução do patrimônio líquido em “Demais despesas - Auditoria e custódia”.

10 Serviços de gestão, custódia, tesouraria e outros serviços contratados

Os serviços de liquidação, custódia, tesouraria, controle de ativos, cálculo da cota, bem como a execução dos procedimentos contábeis para o Fundo, incluindo o controle consolidado da totalidade das cotas escriturais de fundos de investimento, a gestão da carteira, distribuição de cotas e o controle das posições dos condôminos, relativas às movimentações de aplicação e resgate de cotas pelos cotistas, identificados em contas individuais, nas modalidades definidas na legislação em vigor são realizados pela Administradora do Fundo, BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.

Os serviços de consultoria de investimentos são prestados pela Icatu Consultoria de Investimentos Ltda.

11 Tributação

a. Imposto sobre Operações Financeiras (IOF)

Incide IOF à alíquota de 1% ao dia, sobre o valor de resgate das cotas, limitado a um percentual do rendimento da aplicação, decrescente em função do prazo, tendendo a 0% nos 30 dias seguintes à data de aplicação.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

b. Imposto de renda

Os rendimentos auferidos serão tributados pelas regras abaixo:

- Seguindo a expectativa da Administradora e da Gestora de manter a carteira do Fundo com prazo médio superior a trezentos e sessenta e cinco dias, calculado conforme metodologia, regulamentada pela Secretaria da Receita Federal, os rendimentos auferidos estarão sujeitos ao imposto de renda retido na fonte às seguintes alíquotas:
 - I. 22,5% em aplicações com prazo de até 180 dias;
 - II. 20% em aplicações com prazo de 181 a 360 dias;
 - III. 17,5% em aplicações com prazo de 361 a 720 dias;
 - IV. 15% em aplicações com prazo superior a 720 dias.
- Independente do resgate das cotas haverá a retenção de imposto de renda à alíquota de 15%, através da diminuição automática semestral da quantidade de cotas, correspondente ao valor do imposto de renda retido na fonte, sempre no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano. Por ocasião do resgate, aplicar-se-á a alíquota complementar, calculada em função do prazo decorrido de cada aplicação, conforme acima descrito.

A regra tributária acima descrita não se aplica aos cotistas sujeitos às regras de tributação específicas, na forma da legislação em vigor.

12 Política de distribuição de resultados

Os resultados auferidos são incorporados ao patrimônio com a correspondente variação no valor das cotas, de maneira que todos os seus condôminos participem proporcionalmente à quantidade de cotas possuídas.

13 Política de divulgação das informações

A Administradora coloca à disposição dos cotistas e/ou interessados, em sua sede e/ou em sua página na rede mundial de computadores, as seguintes informações:

- Diariamente, valor da cota e do patrimônio líquido do Fundo;
- Mensalmente, balancete, demonstrativo da composição e diversificação da carteira do Fundo, perfil mensal e extrato de conta com informações exigidas nos termos da regulamentação em vigor; e

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

- Anualmente, após o prazo determinado pela legislação vigente, as demonstrações financeiras do Fundo, acompanhadas do relatório dos auditores independentes e a demonstração do desempenho.

14 Outras informações

O valor do patrimônio líquido médio, a variação do benchmark e a rentabilidade do Fundo nos exercícios foram os seguintes:

Informações referentes aos exercícios:	2022	2021
Rentabilidade do Fundo	4,20%	0,69%
Rentabilidade CDI	8,66%	2,27%
Patrimônio líquido médio	4.438	5.865

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

15 Demandas judiciais

Não há registro de demandas judiciais ou extrajudiciais, quer na defesa dos direitos dos cotistas, quer contra a administração do Fundo.

16 Outros assuntos

Desde o início de janeiro de 2020, o surto de coronavírus, que é uma situação em rápida evolução e que vem, impactando adversamente as atividades econômicas globais. O rápido desenvolvimento e fluidez dessa situação impedem qualquer previsão como seu impacto final. Essa situação pode ter um impacto adverso e contínuo nas condições econômicas e de mercado e desencadear um período de desaceleração econômica global, o que poderá trazer reflexos futuros na precificação subsequente da carteira do Fundo, cuja a quota é divulgada diariamente ao mercado.

A Administradora e a Gestora estão monitorando os desenvolvimentos relacionados ao coronavírus e coordenando sua resposta operacional com base nos planos de continuidade de negócios existentes e nas orientações de organizações globais de saúde, governos relevantes e melhores práticas gerais de resposta à pandemia.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

17 Informação adicional

Independência do auditor

Em atendimento à Instrução CVM nº 381, da Comissão de Valores Mobiliários, não foram registrados pagamentos por serviços prestados pelo auditor externo do Fundo, além dos honorários de auditoria das demonstrações financeiras. A política adotada pela Administradora atende aos princípios que preservam a independência do auditor.

18 Informações sobre transações com partes relacionadas

Em atendimento a Instrução CVM nº 514 de 27 de dezembro de 2011, os itens abaixo demonstram as operações realizadas entre o Fundo e instituição Administradora, Gestora ou parte a elas relacionada no exercício findo em 30 de junho de 2022.

a) Disponibilidade

Em 30 de junho de 2022, o Fundo possui saldo em conta corrente, no montante de R\$ 14, com o Banco Votorantim S.A.

b) Despesas administrativas

Em 30 de junho de 2022, o Fundo possui saldo a pagar de remuneração da administração no montante de R\$ 6 o montante refere-se à taxa de administração e à taxa de gestão do Fundo. As despesas a título de remuneração da administração estão sendo apresentadas na Nota 8.

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021

(Em milhares de Reais)

c) Operações compromissadas com partes relacionadas

Operações compromissadas com partes relacionadas			
Mês/Ano	Operações compromissadas realizadas com partes relacionadas / total de operações compromissadas	Volume médio diário / patrimônio médio diário do Fundo	Taxa média contratada / taxa SELIC
Julho de 2021	100,00%	9,42%	99,76%
Agosto de 2021	100,00%	5,95%	99,90%
Setembro de 2021	100,00%	5,65%	99,82%
Outubro de 2021	100,00%	6,19%	99,84%
Novembro de 2021	100,00%	5,40%	99,87%
Dezembro de 2021	100,00%	7,23%	99,89%
Janeiro de 2022	100,00%	10,08%	99,89%
Fevereiro de 2022	100,00%	11,93%	99,90%
Março de 2022	100,00%	11,21%	99,90%
Abril de 2022	100,00%	8,63%	99,92%
Mai de 2022	100,00%	9,70%	99,92%
Junho de 2022	100,00%	11,54%	99,92%

d) Operações de compra e venda definitivas de ativos públicos federais realizadas com partes relacionadas

Títulos Públicos			
Mês/Ano	Operações definitivas de compra e venda de ativos públicos federais realizadas com partes relacionadas/total de operações definitivas com ativos públicos federais (%)	Volume médio diário / patrimônio médio diário do Fundo	(Preço praticado/Preço médio do dia*) (*): ponderado pelo volume Anbima
Dezembro de 2021	100,00%	0,30%	100,00%

**BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito
Privado Fundo de Investimento**
(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Notas explicativas às demonstrações financeiras
Exercícios findos em 30 de junho de 2022 e 2021
(Em milhares de Reais)

e) Despesas de corretagem com partes relacionadas

No exercício findo em 30 de junho de 2022, o total de despesa com corretagem no mercado à vista e futuros, através da corretora Votorantim CTVM, empresa ligada à administradora, foi de R\$ 2.

* * *

Alexandre Luiz Zimath
Diretor

Antônio Tadeu Alves de Oliveira
Contador CRC 337647/O-4

BV Icatu Seg Platinum Previdência Multimercado Crédito Privado Fundo de Investimento

(CNPJ: 08.541.158/0001-80)

(Administrado pela BV Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)

Demonstração da Evolução do Valor da Cota e da Rentabilidade - Não auditado

	Patrimônio líquido médio - R\$	Valor da cota - R\$(*)	Rentabilidade do Fundo %		Rentabilidade CDI %	
			No mês (*)	Acumulada (*)	No mês (*)	Acumulada (*)
Junho de 2021	-	2,672238	-	-	-	-
Julho de 2021	4.484	2,668421	(0,14)	(0,14)	0,36	0,36
Agosto de 2021	4.431	2,652239	(0,61)	(0,75)	0,42	0,78
Setembro de 2021	4.427	2,656198	0,15	(0,60)	0,44	1,22
Outubro de 2021	4.440	2,667873	0,44	(0,16)	0,48	1,71
Novembro de 2021	4.446	2,677670	0,37	0,20	0,59	2,31
Dezembro de 2021	4.403	2,697748	0,75	0,95	0,76	3,09
Janeiro de 2022	4.392	2,716360	0,69	1,65	0,73	3,84
Fevereiro de 2022	4.395	2,732019	0,58	2,24	0,75	4,62
Março de 2022	4.430	2,769053	1,36	3,62	0,93	5,59
Abril de 2022	4.453	2,777365	0,30	3,93	0,83	6,47
Mai de 2022	4.476	2,794464	0,92	4,57	1,03	7,57
Junho de 2022	4.479	2,784480	0,26	4,20	1,01	8,66

(*) Valor da cota e rentabilidade calculada com base no último dia útil do mês.

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

Certificate Of Completion

Envelope Id: 1A796DE4AB8D438DA96B560D5404D12E

Status: Completed

Subject: Complete with DocuSign: 269BVICATUSEGPLATINUM22.JUN.pdf

Source Envelope:

Document Pages: 22

Signatures: 1

Envelope Originator:

Certificate Pages: 2

Initials: 0

Marcelo Kenji

AutoNav: Enabled

Av. Francisco Matarazzo, 1400, Torre Torino, Água

Envelopeld Stamping: Enabled

Branca

Time Zone: (UTC-03:00) Brasilia

São Paulo, SP 05001-100

marcelo.kenji@pwc.com

IP Address: 18.231.224.29

Record Tracking

Status: Original

Holder: Marcelo Kenji

Location: DocuSign

28 September 2022 | 14:23

marcelo.kenji@pwc.com

Status: Original

Holder: CEDOC Brasil

Location: DocuSign

28 September 2022 | 17:11

BR_Sao-Paulo-Arquivo-Atendimento-Team

@pwc.com

Signer Events

Wilian Shigueaki Tatebe

wilian.shigueaki@pwc.com

PwC

Security Level: Email, Account Authentication (None), Digital Certificate

Signature Provider Details:

Signature Type: ICP Smart Card

Signature Issuer: AC SERASA RFB v5

Electronic Record and Signature Disclosure:

Not Offered via DocuSign

Signature

DocuSigned by:



426B6DDBDFAE45F...

Signature Adoption: Pre-selected Style

Using IP Address: 134.238.160.170

Timestamp

Sent: 28 September 2022 | 14:29

Viewed: 28 September 2022 | 17:10

Signed: 28 September 2022 | 17:11

In Person Signer Events**Signature****Timestamp****Editor Delivery Events****Status****Timestamp****Agent Delivery Events****Status****Timestamp****Intermediary Delivery Events****Status****Timestamp****Certified Delivery Events****Status****Timestamp****Carbon Copy Events****Status****Timestamp**

Marcelo Kenji

marcelo.kenji@pwc.com

PricewaterhouseCoopers

Security Level: Email, Account Authentication (None)

Electronic Record and Signature Disclosure:

Not Offered via DocuSign

COPIED

Sent: 28 September 2022 | 17:11

Viewed: 28 September 2022 | 17:11

Signed: 28 September 2022 | 17:11

Witness Events**Signature****Timestamp****Notary Events****Signature****Timestamp****Envelope Summary Events****Status****Timestamps**

Envelope Summary Events	Status	Timestamps
Envelope Sent	Hashed/Encrypted	28 September 2022 14:29
Certified Delivered	Security Checked	28 September 2022 17:10
Signing Complete	Security Checked	28 September 2022 17:11
Completed	Security Checked	28 September 2022 17:11

Payment Events	Status	Timestamps
-----------------------	---------------	-------------------