Demonstrações Financeiras

Truxt I Macro Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado

CNPJ: 26.277.600/0001-95

(Administrado pela Intrag Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. - CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Exercícios findos em 31 de julho de 2022 e 2021
com Relatório do Auditor Independente sobre as Demonstrações Financeiras

São Paulo Corporate Towers
Av. Presidente Juscelino Kubitschek, 1.909
Vila Nova Conceição
04543-011 - São Paulo – SP - Brasil

Tel: +55 11 2573-3000
ey.com.br

Relatório do auditor independente sobre as demonstrações financeiras

Aos Cotistas e à Administradora do
Truxt I Macro Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado
(Administrado pela Intrag Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.)
São Paulo - SP

Opinião

Examinamos as demonstrações financeiras do Truxt I Macro Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado ("Fundo") que compreendem a demonstração da composição e diversificação das aplicações em 31 de julho de 2022 e a respectiva demonstração da evolução do patrimônio líquido para o exercício findo nessa data, bem como as correspondentes notas explicativas, incluindo o resumo das principais políticas contábeis.

Em nossa opinião, as demonstrações financeiras acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Truxt I Macro Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado em 31 de julho 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 regulamentados pela Instrução CVM n° 555/14.

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 de acordo com 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 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. Para o assunto abaixo, a descrição de como nossa auditoria tratou o assunto, incluindo quaisquer comentários sobre os resultados de nossos procedimentos, é apresentada no contexto das demonstrações financeiras tomadas em conjunto.

Nós cumprimos as responsabilidades descritas na seção intitulada “Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras”, incluindo aquelas em relação a esse principal assunto de auditoria. Dessa forma, nossa auditoria incluiu a condução de procedimentos planejados para responder a nossa avaliação de riscos de distorções significativas nas demonstrações financeiras. Os resultados de nossos procedimentos, incluindo aqueles executados para tratar o assunto abaixo, fornecem a base para nossa opinião de auditoria sobre as demonstrações financeiras do Fundo.

Avaliação de aplicações em cotas de fundos de investimento

Conforme apresentado na demonstração da composição e diversificação das aplicações, a aplicação de investimentos em cotas de fundos de investimento representava 100,25% do patrimônio líquido do Fundo. Considerando o impacto direto na mensuração do valor justo das cotas do Fundo e devido à materialidade no contexto das demonstrações financeiras tomadas em conjunto, a aplicação de investimentos em cotas de fundos de investimento foi considerada um principal assunto de auditoria.

Como nossa auditoria conduziu o assunto

Nossos procedimentos de auditoria incluíram, entre outros, a obtenção das últimas demonstrações financeiras auditadas dos fundos investidos, a verificação dos extratos dos administradores dos fundos investidos para confirmação da posição de cotas detidas pelo Fundo e a verificação da correta valorização dos investimentos através das informações divulgadas pelos administradores dos fundos investidos. Adicionalmente, para casos considerados relevantes, efetuamos testes de valorização nos ativos que compõem a aplicação dos fundos investidos.

Baseados no resultado dos procedimentos de auditoria efetuados sobre a aplicação em cotas de fundos de investimento, que está consistente com a avaliação da Administradora do Fundo, consideramos que os critérios e premissas adotados pela Administradora do Fundo são aceitáveis, no contexto das demonstrações financeiras tomadas em conjunto.

Responsabilidades da Administradora do Fundo pelas demonstrações financeiras

A Administradora 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 regulamentados pela Instrução CVM nº 555/14 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 Administradora do Fundo é responsável pela avaliação da capacidade de o 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 não ser que a Administradora do Fundo pretenda liquidar o Fundo ou cessar suas operações, ou não tenha nenhuma alternativa realista para evitar o encerramento das operações.

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 detecta 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 da 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 obtivemos 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.

- Obtivemos 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 Administradora do Fundo.

- Concluímos sobre a adequação do uso, pela Administradora do Fundo, 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 planejado, da época da auditoria e das constatações significativas de auditoria, inclusive as eventuais deficiências significativas nos controles internos que identificamos durante nossos trabalhos.

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, 26 de outubro de 2022.

ERNST & YOUNG
Auditores Independentes S.S.
CRC 2SP034519/O-F

Emerson Morelli
Contador CRC-1SP249401/O-4

TRUXT I MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

(CNPJ: 26.277.600/0001-95)

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

(CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Demonstração da Composição e Diversificação das Aplicações em 31 de julho de 2022.

Aplicações/Especificação	Quantidade	Mercado / Realização R$ Mil	% sobre Patrimônio Líquido
1.DISPONIBILIDADES		**3**	**0,00**
Depósitos Bancários		3	0,00
2.COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO		**317.143**	**100,25**
TRUXT MACRO MASTER FI MULTIMERCADO	187.424.163,315	317.098	100,24
ITAÚ CUSTÓDIA RENDA FIXA CP CAIXA FI	1.723,254	45	0,01
3.VALORES A RECEBER		**969**	**0,31**
4.TOTAL DO ATIVO		**318.115**	**100,56**
5.VALORES A PAGAR		**1.775**	**0,56**
6.TOTAL DO PASSIVO		**1.775**	**0,56**
7.PATRIMÔNIO LÍQUIDO		**316.340**	**100,00**

As notas explicativas da administradora são parte integrante das demonstrações financeiras.

TRUXT I MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

(CNPJ: 26.277.600/0001-95)

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

(CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Demonstração da Evolução do Patrimônio Líquido

Exercícios findos em 31 de julho de 2022 e 2021

(Valores em milhares de reais, exceto o valor unitário das cotas)

				julho 2022	julho 2021
Patrimônio líquido no início do exercício					
Representado por	349.351.769,390	cotas a R$	1,314610	**459.261**	
	533.659.238,077	cotas a R$	1,254290		**669.364**
Cotas emitidas	32.959.221,658	cotas		52.085	
	128.770.017,763	cotas			151.653
Cotas resgatadas	169.650.602,773	cotas		(213.623)	
	313.077.486,450	cotas			(353.484)
Variação no resgate de cotas				(27.726)	(36.724)
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício				**269.997**	**430.809**
Composição do Resultado do exercício:					
A - Ações (ou Cotas de Fundos)				**56.899**	**43.143**
Valorização / Desvalorização a preço de mercado				56.899	43.143
B - Demais Receitas				**1**	**3**
Taxa de saida				0	2
Receitas diversas				1	1
C - Demais Despesas				**10.557**	**14.694**
Remuneração da administração				10.345	12.877
Acordo de remuneração				0	1.482
Auditoria e custódia				169	298
Publicações e correspondência				0	5
Taxa de fiscalização				37	26
Despesas diversas				6	6
Total do resultado do exercício				**46.343**	**28.452**
Patrimônio líquido no final do exercício					
Representado por	212.660.388,275	cotas a R$	1,487538	**316.340**	
	349.351.769,390	cotas a R$	1,314610		**459.261**

As notas explicativas da administradora são parte integrante das demonstrações financeiras.

TRUXT I MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

(CNPJ: 26.277.600/0001-95)

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

(CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Notas explicativas da administradora às demonstrações financeiras em 31 de julho de 2022 e 2021.
Em milhares de reais

1. Contexto operacional

O Fundo foi constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo de duração indeterminado. Iniciou suas atividades em 02/06/2017, destina-se a investidor não qualificado e recebe recursos de fundos de investimento, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento, pessoas físicas e/ou jurídicas, clientes da Administradora, da Gestora ou de empresas a elas ligadas. Seu objetivo é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem em ativos financeiros de diferentes naturezas, riscos e características, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial, buscando rentabilidade superior ao do CDI. A estratégia adotada decorre e reflete a política de investimento do Fundo conforme descrito no seu regulamento.

Os investimentos em fundos não são garantidos pela administradora ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Não obstante a diligência da administradora no gerenciamento dos recursos do Fundo, a política de investimento coloca em risco o patrimônio deste, pelas características dos papéis que o compõem, os quais sujeitam-no às oscilações do mercado e aos riscos de crédito inerentes a tais investimentos, podendo, inclusive, ocorrer perda do capital investido.

2. Elaboração das demonstrações financeiras

Foram preparadas de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos Fundos de Investimento, previstas no Plano Contábil dos Fundos de Investimento - COFI e demais orientações emanadas da Comissão de Valores Mobiliários - CVM, especialmente pela Instrução CVM nº 555/14 e alterações posteriores.

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

3. Práticas contábeis

Os títulos componentes da carteira do Fundo são assim avaliados:

Títulos avaliados a preço de mercado:

Cotas de fundo de investimento - as aplicações em cotas de fundo de investimento são atualizadas, diariamente, pelos respectivos valores das cotas divulgadas pelos seus respectivos administradores.

Apuração do resultado - as receitas e despesas são apropriadas de acordo com o regime de competência.

4. Riscos

- Risco de mercado

O valor dos ativos que integram a carteira do Fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com as flutuações de preços e cotações de mercado. Em caso de queda o patrimônio do Fundo pode ser afetado negativamente por tempo indeterminado.

- Risco sistêmico

Os acontecimentos econômicos e políticos nacionais e internacionais podem afetar negativamente o mercado financeiro com consequentes alterações nas taxas de juros e câmbio, nos preços dos papéis e nos ativos em geral. Essas alterações podem afetar a rentabilidade do Fundo.

- Gerenciamento de risco

Para monitoramento do nível de exposição do Fundo a risco, a gestora acompanhará e controlará os possíveis riscos existentes nas operações do Fundo, utilizando-se da metodologia prevista em sua Política de Gestão de Risco, a qual deverá observar as disposições pertinentes constantes da regulamentação aplicável à administração de carteira de valores mobiliários.

A administradora, por sua vez, nos termos da regulamentação aplicável, supervisiona a gestão de riscos implementada pela gestora, por meio de processo de due diligence e de monitoramento dos gestores.

Na ocasião da due diligence, são verificados aspectos como estrutura, conhecimento técnico da equipe, sistemas, governança e comitês existentes.

Já no processo de monitoramento, periodicamente, a administradora verifica (i) a consistência do controle/monitoramento de risco da gestora à política de gerenciamento de riscos para a tomada de decisões de investimento/desinvestimento; (ii) a compatibilidade entre a política de investimentos do Fundo e o respectivo limite de risco, bem como eventuais alterações desse limite; (iii) eventuais desenquadramentos em relação ao limite de risco estabelecido para o Fundo e planos de ação adotados pela gestora para sanar tais desenquadramentos.

A utilização do modelo de controle não caracteriza a eliminação total dos fatores de risco a que o Fundo está sujeito. Apesar da gestora adotar procedimentos para gerenciar a exposição de risco do Fundo e da administradora utilizar procedimentos para supervisionar o gerenciamento de risco da gestora, acontecimentos eventuais e inesperados podem impactar negativamente a performance do Fundo.

5. Emissão e resgate de cotas

Emissão - é processada com a cota apurada no primeiro dia útil da efetiva disponibilidade dos recursos confiados pelo investidor à Administradora, em sua sede ou dependências.

Resgate - é processado com base no valor da cota apurado no trigésimo dia da entrada do pedido de resgate, na sede ou dependências da Administradora. O pagamento do resgate é efetuado, sem a cobrança de qualquer taxa ou despesa, no primeiro dia útil da conversão da cota.

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, a Administradora pode declarar o fechamento do Fundo para a realização de resgates.

Taxa de saída - é cobrado no mesmo dia do resgate, em benefício do Fundo, percentual de 5%, incidente sobre os valores líquidos a serem resgatados. Para o cotista que programar previamente o pedido de resgate mediante informação à Administradora, com antecedência mínima de 5 dias úteis da data da apuração da cota, a taxa de saída deixará de ser cobrada.

No exercício atual, não houve recebimento (exercício anterior – R$ 2) a título de taxa de saída.

A apuração da variação no resgate das cotas, quando aplicável, é demonstrada considerando-se o valor original das aquisições das cotas pelos cotistas do Fundo e os ganhos e perdas havidos.

6. Remuneração da administradora

Taxa de administração - é de 1,90% ao ano, podendo chegar a 2,50% sobre o patrimônio do Fundo em função da taxa de administração dos fundos investidos, calculada e provisionada diariamente e paga mensalmente à administradora.

Esse percentual compreende:

a) a taxa de administração do Fundo e do(s) Fundo(s) de Investimento, inclusive Fundo(s) de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento, nos quais este aplica;

b) o somatório das remunerações devidas pelo Fundo a cada um dos prestadores de serviços por ele contratados.

O Fundo pagará diretamente a cada prestador de serviço a parcela da taxa de administração que lhe é devida, se for o caso, na forma ajustada no respectivo contrato.

No exercício atual, foi provisionada a importância de R$ 7.433 (exercício anterior - R$ 11.261) a título de taxa de administração.

Taxa de desempenho - é de 20% sobre o resultado que exceder 100% da variação do CDI de um dia, apurado pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa Balcão. Essa taxa é calculada e apropriada por dia útil e paga no mês subsequente ao encerramento dos meses de junho e dezembro de cada ano, desde que o período não seja inferior a 6 meses, ou proporcionalmente, na hipótese de resgate, à Gestora, se devida.

No exercício atual, foi provisionada a importância de R$ 2.912 (exercício anterior - R$ 3.098) a título de taxa de desempenho.

Taxa de custódia - a taxa máxima anual de custódia paga pelo Fundo será de 0,06% sobre o patrimônio do Fundo, com o mínimo mensal de até R$ 7.

No exercício atual, foi provisionada a importância de R$ 109 (exercício anterior - R$ 207) a título de taxa de custódia.

7. Gestão, custódia, tesouraria, consultoria e serviços terceirizados

Os serviços são prestados por:

Custódia:	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Controladoria:	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Escrituração:	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Gestão:	TRUXT INVESTIMENTOS LTDA.
Tesouraria:	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Distribuição das Cotas:	INTRAG DISTR DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA

TRUXT I MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

(CNPJ: 26.277.600/0001-95)

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

(CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Notas explicativas da administradora às demonstrações financeiras em 31 de julho de 2022 e 2021.
Em milhares de reais

8. Transações com partes relacionadas

Em 31/07/2022 o Fundo possuía um saldo de conta corrente no montante de R$ 3 com o Itaú Unibanco S.A.

As operações do Fundo são feitas substancialmente por intermédio de corretora ligada à Administradora ou à Gestora da carteira. Os títulos emitidos por empresas ligadas à Administradora ou à Gestora encontram-se, quando aplicável, em destaque na Demonstração da Composição e Diversificação das Aplicações.

Os serviços de administração, gestão, custódia, controladoria, escrituração, tesouraria e distribuição de cotas, cuja despesa reconhecida no resultado do exercício foi de R$ 10.454 (nota 6), foram prestados por empresas relacionadas à Administradora ou à Gestora do Fundo.

9. Legislação tributária

9.1. Fundo - Os rendimentos e ganhos auferidos com operações realizadas pela carteira do Fundo não estão sujeitos ao imposto de renda nem ao IOF.

9.2. Cotistas - Em conformidade com a Lei nº 11.033, de 21 de dezembro de 2004, os rendimentos de fundos de longo prazo, produzidos a partir de 1º de janeiro de 2005 sujeitam-se à incidência do imposto de renda na fonte, às seguintes alíquotas: 22,5% em aplicações com prazo até 180 dias; 20% em aplicações com prazo de 181 dias até 360 dias; 17,5% em aplicações com prazo de 361 dias até 720 dias; e 15% em aplicações com prazo acima de 720 dias. Os rendimentos serão tributados semestralmente, nos meses de maio e novembro de cada ano, à alíquota de 15% (quinze por cento) e, por ocasião do resgate das cotas, será aplicada alíquota complementar, variável em razão do prazo da aplicação.

9.3. IOF (Decreto n° 6.306, de 14 de dezembro de 2007) - Os resgates, quando realizados em prazo inferior a 30 dias, estarão sujeitos à cobrança de IOF. A alíquota do IOF será de 1% (um por cento) ao dia sobre o valor do resgate, limitado a um porcentual do rendimento da operação, decrescente em função do prazo da aplicação. Para os resgates efetuados a partir do trigésimo dia da data da aplicação, não haverá cobrança desse IOF.

Os cotistas isentos, os imunes e os amparados por norma legal ou medida judicial específicas não sofrem retenção do imposto de renda na fonte e ou IOF.

10. Política de distribuição de resultados

Os resultados dos títulos que compõem a carteira do Fundo são reinvestidos no próprio Fundo.

TRUXT I MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

(CNPJ: 26.277.600/0001-95)

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

(CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Notas explicativas da administradora às demonstrações financeiras em 31 de julho de 2022 e 2021.
Em milhares de reais

11. Política de divulgação das informações

A Administradora colocará à disposição dos interessados, em sua sede e/ou site, as seguintes informações:

- Diariamente, o valor da cota e do patrimônio líquido do Fundo;

- Mensalmente, até 10 dias após o encerramento do mês, balancete, demonstrativo de composição e diversificação da carteira e informações relativas ao perfil mensal; e

- Anualmente, no prazo de até 90 dias contados a partir do encerramento do exercício, as demonstrações financeiras acompanhadas do relatório do auditor independente.

A Administradora disponibilizará aos cotistas, mensalmente, extrato de conta contendo o saldo e o valor das cotas no início e no final do período e a movimentação ocorrida ao longo do mesmo e rentabilidade do Fundo auferido entre o último dia útil do mês anterior e o último dia útil do mês de referência do extrato.

As informações poderão ser obtidas por meio do telefone de Atendimento ao Cotista: 0800-728-0728.

12. Outras informações

Exercício Findo em	Patrimônio Líquido Médio	Rentabilidade %	CDI %
29/07/2022	392.166	13,15	9,39
30/07/2021	596.585	4,81	2,43

13. Demandas judiciais

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

14. Outros serviços prestados pelos auditores independentes

De acordo com a Instrução CVM nº 577, de 7 de julho de 2016, a administradora não contratou outros serviços, que envolvam atividades de gestão de recursos de terceiros, junto ao auditor independente responsável pelo exame das demonstrações financeiras do Fundo, que não seja o de auditoria externa.

TRUXT I MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

(CNPJ: 26.277.600/0001-95)

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

(CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Notas explicativas da administradora às demonstrações financeiras em 31 de julho de 2022 e 2021.
Em milhares de reais

15. Análise de sensibilidade

Data de Referência	29/07/2022
Patrimônio Líquido	316.340
VaR	0,44%

Metodologia:

O VaR paramétrico representa a perda máxima esperada para um dia com o intervalo de confiança de 95%.

A volatilidade é obtida através do desvio padrão dos retornos com a janela de 126 dias úteis e decaimento de 0,94 e as correlações entre os fatores de risco também utilizam a mesma janela de 126 dias úteis.

O cálculo do VaR é um método estatístico dependente de dados de mercado, parâmetros e pressupostos, portanto poderá haver perdas de valores superiores ao estimado, conforme as oscilações de mercado.

16. Informações adicionais

Em dezembro de 2019, um novo agente de coronavírus ("COVID-19") foi relatado em Wuhan, China e em 30 de janeiro de 2020 a Organização Mundial da Saúde declarou COVID-19 como uma "Emergência em Saúde Pública de Interesse Internacional". Desde então, o surto do COVID-19 resultou em impactos significativos nos mercados financeiros mundiais, bem como na rentabilidade do Fundo e poderá continuar influenciando prospectivamente, gerando oscilações e eventuais quedas nos preços dos ativos financeiros investidos pelo Fundo.

WESLEI PACHECO LIMA
CRC 1SP305053/O-9

ROBERTA ANCHIETA DA SILVA
Diretora Responsável

TRUXT I MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

(CNPJ: 26.277.600/0001-95)

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

(CNPJ: 62.418.140/0001-31)

Demonstração da Evolução do Valor da Cota e da Rentabilidade – Não auditado.

Data	Valor da Cota	Rentabilidade em %				Patrimônio Líquido Médio Mensal
		Fundo		CDI		
	R$	Mensal	Acumulada (*)	Mensal	Acumulada (*)	R$ mil
31/07/2020	1,254290	-	18,60	-	12,05	-
31/08/2020	1,271445	1,37	17,00	0,16	11,87	672.746
30/09/2020	1,267728	(0,29)	17,34	0,16	11,70	658.074
30/10/2020	1,261620	(0,48)	17,91	0,16	11,52	649.001
30/11/2020	1,270707	0,72	17,06	0,15	11,36	627.274
31/12/2020	1,282630	0,94	15,98	0,16	11,17	621.490
29/01/2021	1,287257	0,36	15,56	0,15	11,01	566.780
26/02/2021	1,318336	2,41	12,83	0,13	10,86	552.850
31/03/2021	1,324454	0,46	12,31	0,20	10,64	555.584
30/04/2021	1,324151	(0,02)	12,34	0,21	10,41	552.292
31/05/2021	1,322278	(0,14)	12,50	0,27	10,11	596.773
30/06/2021	1,317994	(0,32)	12,86	0,30	9,78	603.444
30/07/2021	1,314610	(0,26)	13,15	0,36	9,39	501.641
31/08/2021	1,338401	1,81	11,14	0,42	8,93	463.221
30/09/2021	1,361659	1,74	9,24	0,44	8,45	468.250
29/10/2021	1,374786	0,96	8,20	0,48	7,93	467.988
30/11/2021	1,360572	(1,03)	9,33	0,59	7,31	451.411
31/12/2021	1,341892	(1,37)	10,85	0,76	6,49	417.817
31/01/2022	1,352991	0,83	9,94	0,73	5,72	402.815
25/02/2022	1,376979	1,77	8,03	0,75	4,93	376.008
31/03/2022	1,388486	0,84	7,13	0,92	3,97	354.327
29/04/2022	1,431161	3,07	3,94	0,83	3,11	329.290
31/05/2022	1,443290	0,85	3,07	1,03	2,06	326.166
30/06/2022	1,479885	2,54	0,52	1,01	1,03	323.548
29/07/2022	1,487538	0,52	-	1,03	-	323.170

(*) Percentual acumulado desde a data até 29/07/2022.

Rentabilidade passada não é garantia de rentabilidade futura.