

ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 10.740.670/0001-06 - Caixa Brasil Títulos Públicos IRF-M 1

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b

Data do Termo: 30/06/2021

Conclusão do Credenciamento: Fundo enquadrado em relação à Resolução 3922/2010.

INSTITUIÇÕES

Administrador: 00.360.305/0001-04 - Caixa Econômica Federal

Gestor: 00.360.305/0001-04 - Caixa Econômica Federal

Art. 15º da Resolução 3922/2010: Ambas as instituições atendem ao inciso I do parágrafo 2º.

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Aplicação Inicial Mínima (R\$): 1.000,00

Aplicação Adicional Mínima (R\$): 0,00

Data de Início: 28/05/2010

Índice de Referência: IRF-M 1

Carência: Não há

Prazo de Resgate: D+0

Categoria de Investidor: Geral

Taxa de Saída: 0,00

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Performance: Não há

Investe em cotas de outros fundos: Não

Possui ativos de Emissores Privados: Não

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

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

Investir em carteira composta por títulos públicos e operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais, estando exposto ao risco das variações das taxas prefixadas e/ou pós fixadas. O fundo fica sujeito ao risco sistêmico, decorrente de todo o mercado, ao risco referente aos ativos investidos pelo gestor. Há mais riscos que podem ser consultados no regulamento do fundo, mas o destaque cabe aos citados anteriormente.

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 5 outros fundos, de mesmo benchmark (IRF-M 1) e enquadramento (7°, I, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,20%, ficou abaixo da média de 0,21% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 1,82%, performou acima da média de 1,68%. Base de comparação:

08.703.063/0001-16 - Itaú Institucional IRF-M 1 - Tx Adm: 0,18 - Rent 12M: 1,78

10.979.025/0001-32 - Santander Títulos Públicos IRF-M 1 - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 1,71

11.328.882/0001-35 - BB FIC Previdenciário Títulos Públicos IRF-M 1 - Tx Adm: 0,10 - Rent 12M: 1,65

11.484.558/0001-06 - Bradesco Títulos Públicos IRF-M 1 - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 1,64

10.979.017/0001-96 - Santander FIC Títulos Públicos IRF-M 1 - Tx Adm: 0,40 - Rent 12M: 1,47

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 tem como objetivo proporcionar rentabilidade compatível ao IRF-M 1, por meio da aplicação em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais. Não há cobrança de taxa de performance.

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

O fundo não possui carência para resgate. Sua liquidez é em D+0.

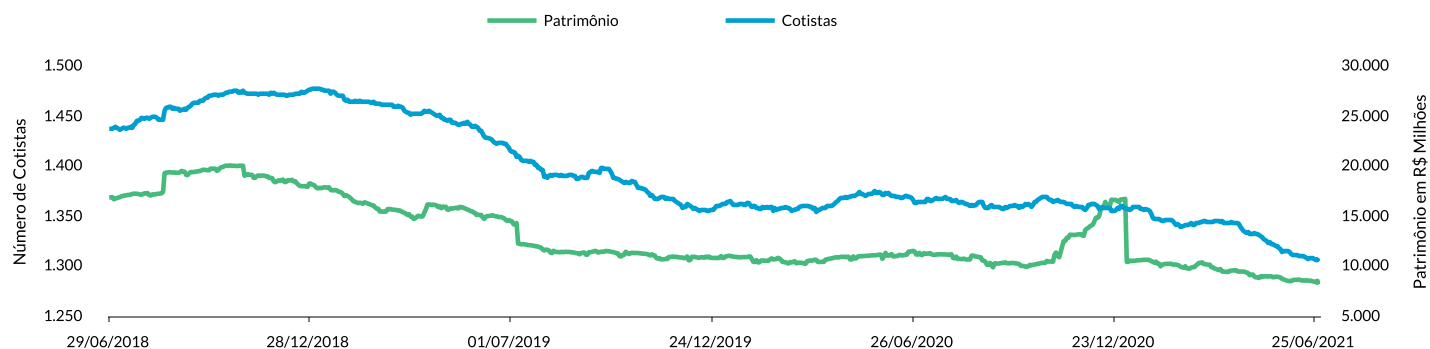
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foram observados 5 fundos da gestora 00.360.305/0001-04 - Caixa Econômica Federal, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 01.165.780/0001-92, 03.737.206/0001-97, 68.623.479/0001-56, 05.114.716/0001-33, 00.834.074/0001-23. Em matéria de performance, 2 ficaram acima 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	8.267.613.291,28	1309
Médio em 12 meses	10.850.541.845,44	1350
Médio em 24 meses	11.033.182.011,80	1362

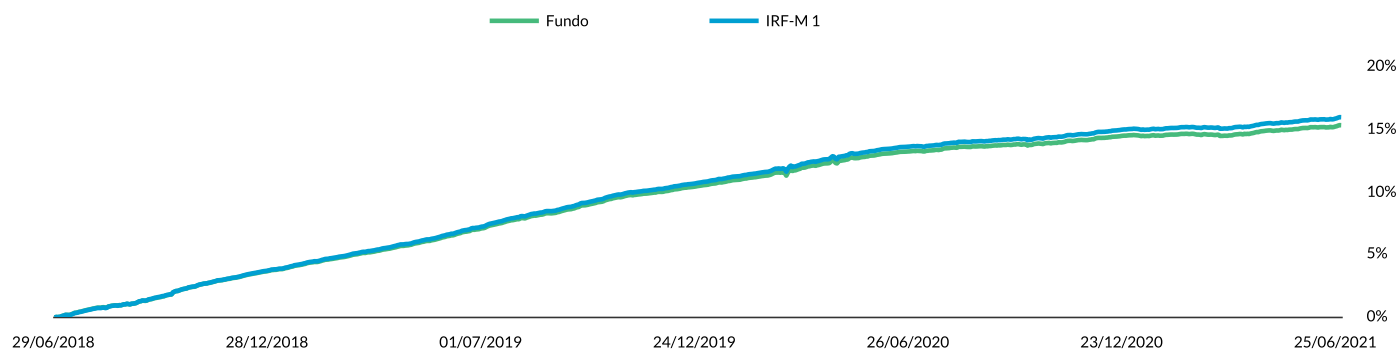
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,57	0,45	0,44	0,50	0,65	0,57	0,70	0,52	0,63	0,61	0,31	0,40	6,55
IRF-M 1	0,58	0,47	0,47	0,50	0,68	0,58	0,72	0,55	0,64	0,62	0,33	0,42	6,76
% IRF-M 1	97,94	95,98	94,05	100,07	96,73	98,71	97,60	95,97	97,37	97,17	94,87	96,10	96,93

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10	0,13	0,14	0,22	0,28	3,63
IRF-M 1	0,44	0,38	0,60	0,45	0,42	0,28	0,24	0,12	0,15	0,16	0,23	0,31	3,84
% IRF-M 1	95,43	95,77	97,32	97,31	94,61	91,75	101,08	81,31	88,92	87,20	95,17	91,88	94,52

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,03	0,02	0,01	0,28	0,17	0,19							0,70
IRF-M 1	0,04	0,04	0,04	0,27	0,20	0,22							0,82
% IRF-M 1	57,98	45,80	20,73	102,85	86,63	89,31							85,67

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	5.436.518.450,54	55,46
Operações Compromissadas	4.364.837.088,17	44,53
Mercado Futuro - Posições compradas	730.380,74	0,01
Valores a receber	730.130,95	0,01
Disponibilidades	4.716,08	0,00
Valores a pagar	-133.898,30	0,00

Obs.: Informações referentes à 31/03/2021.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

Ao assinar o Credenciamento, os responsáveis atestam que:

- i) 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;
- ii) 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.
- iii) 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