

ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 10.646.895/0001-90 - Caixa FIC Novo Brasil Referenciado IMA-B

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: FI Renda Fixa Referenciado - Art. 7º, III, a

Data do Termo: 30/07/2021

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: 27/10/2009

Índice de Referência: IMA-B

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: Sim

10.740.739/0001-93 – Renda Fixa – 7º, III, a – 100,00%

Obs.: Informações referentes à 30/07/2021.

Possui ativos de Emissores Privados: Sim

Sim - Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira

Sim - 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 17/12/2020.

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

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

Investir no mínimo 95% do patrimônio líquido do fundo em cotas de fundos de investimento que apliquem em carteira de ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias, composta por ativos financeiros indexados a taxas prefixadas, pós fixados e/ou atrelados a índices de preços. O fundo poderá aplicar, direta e/ou indiretamente, em crédito privado até o limite de 49% do seu patrimônio líquido. 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 3 outros fundos, de mesmo benchmark (IMA-B) e enquadramento (7°, III, a) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,20%, ficou abaixo da média de 0,31% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 2,25%, performou acima da média de 1,96%. Base de comparação:

11.087.118/0001-15 - Sicredi FIC Referenciado Institucional IMA-B - Tx Adm: 0,18 - Rent 12M: 2,04

14.115.118/0001-70 - Mongeral Aegon Inflação Referenciado IMA-B - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 1,84

11.311.863/0001-04 - Banrisul Prev. Municipal III Referenciado IMA B - Tx Adm: 0,35 - Rent 12M: 1,70

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 buscar rentabilidade que acompanhe a variação do subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B, por meio da aplicação dos recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa. 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.

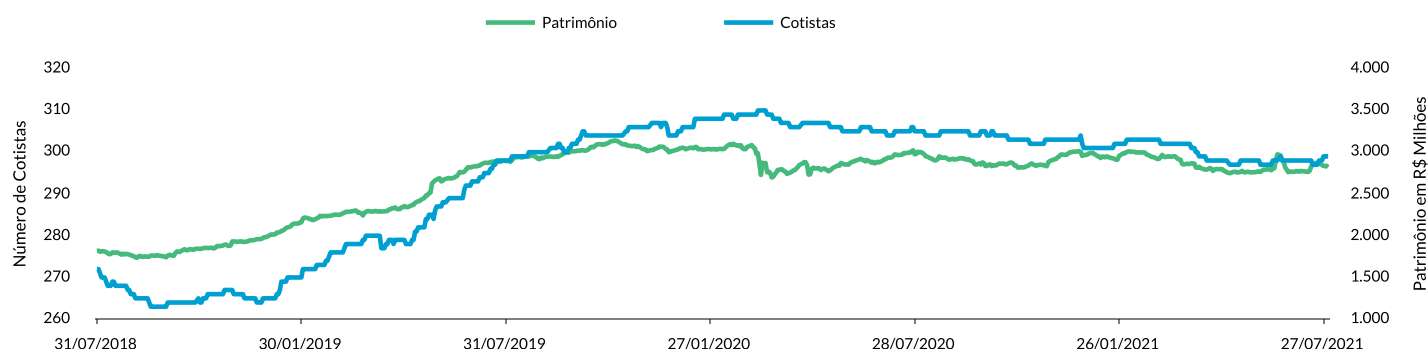
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

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, 1 ficou 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

O gestor é responsável pela aplicação dos fundos Master, de acordo com as normas estabelecidas no Regulamento do Fundo. Na data de análise o fundo está aplicando em fundos enquadrados pela CMN.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	2.818.884.270,28	299
Médio em 12 meses	2.879.659.449,09	301
Médio em 24 meses	2.920.713.161,09	303

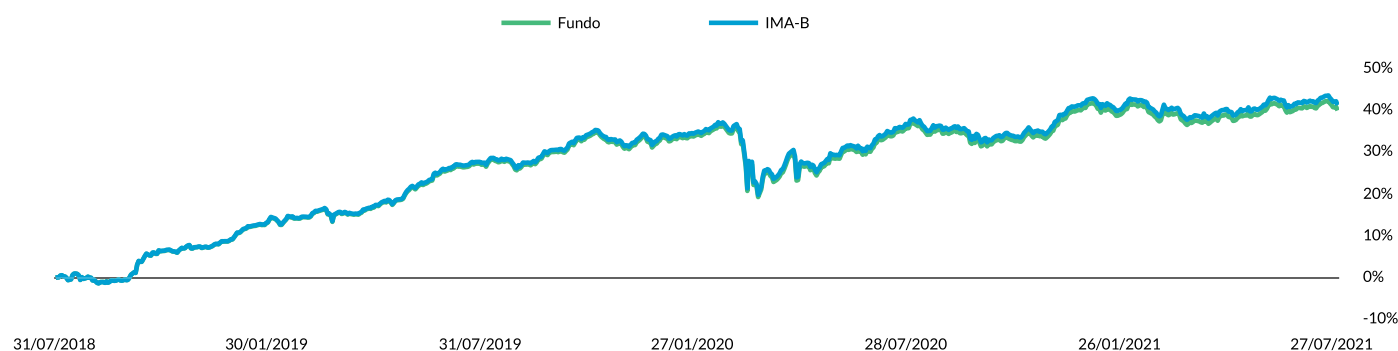
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	4,32	0,55	0,56	1,48	3,58	3,68	1,26	-0,43	2,85	3,35	-2,53	1,99	22,46
IMA-B	4,37	0,55	0,58	1,51	3,66	3,73	1,29	-0,40	2,86	3,36	-2,45	2,01	22,95
% IMA-B	98,95	100,05	96,54	98,50	97,61	98,60	97,83	106,27	99,49	99,47	103,08	99,31	97,88

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,23	0,44	-7,00	1,25	1,49	2,02	4,40	-1,85	-1,54	0,20	1,95	4,85	6,05
IMA-B	0,26	0,45	-6,97	1,31	1,52	2,05	4,39	-1,80	-1,51	0,21	2,00	4,85	6,41
% IMA-B	87,80	96,88	100,40	94,95	97,87	98,87	100,23	102,92	101,79	92,21	97,37	100,01	94,46

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-0,88	-1,55	-0,49	0,63	1,06	0,43	0,27						-0,56
IMA-B	-0,85	-1,52	-0,46	0,65	1,06	0,42	0,28						-0,45
% IMA-B	103,58	102,26	106,38	96,21	100,40	102,43	96,91						125,30

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Cotas de Fundos	2.819.014.372,33	100,00
Valores a receber	5.595,64	0,00
Disponibilidades	0,00	0,00
Valores a pagar	-89.854,63	0,00

Obs.: Informações referentes à 30/07/2021.

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