

ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 14.508.605/0001-00 - Caixa Brasil Títulos Públicos IRF-M

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: 16/08/2012

Índice de Referência: IRF-M

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, com prazo médio superior a 365 dias, 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 4 outros fundos, de mesmo benchmark (IRF-M) e enquadramento (7°, I, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,20%, ficou abaixo da média de 0,26% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de -0,09%, performou acima da média de -0,12%. Base de comparação:

13.455.197/0001-03 - Santander Títulos Públicos Renda Fixa IRF-M - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 0,02

10.396.381/0001-23 - Itaú FIC Pré-Fixado - Tx Adm: 0,18 - Rent 12M: -0,07

07.111.384/0001-69 - BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: -0,09

16.844.885/0001-45 - Banrisul Foco IRF-M - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: -0,36

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, por meio da aplicação 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.

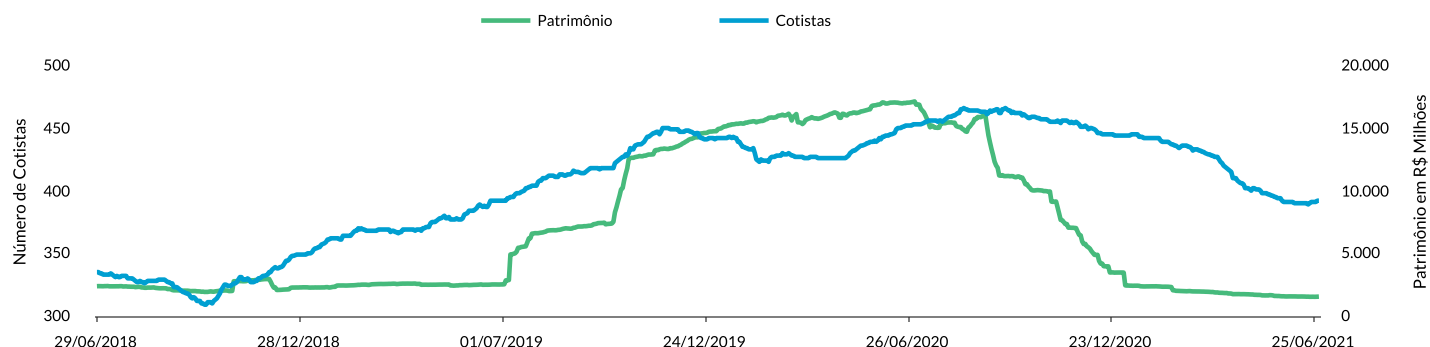
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

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, 5 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	1.645.783.274,49	393
Médio em 12 meses	6.654.924.801,29	439
Médio em 24 meses	9.688.492.506,67	434

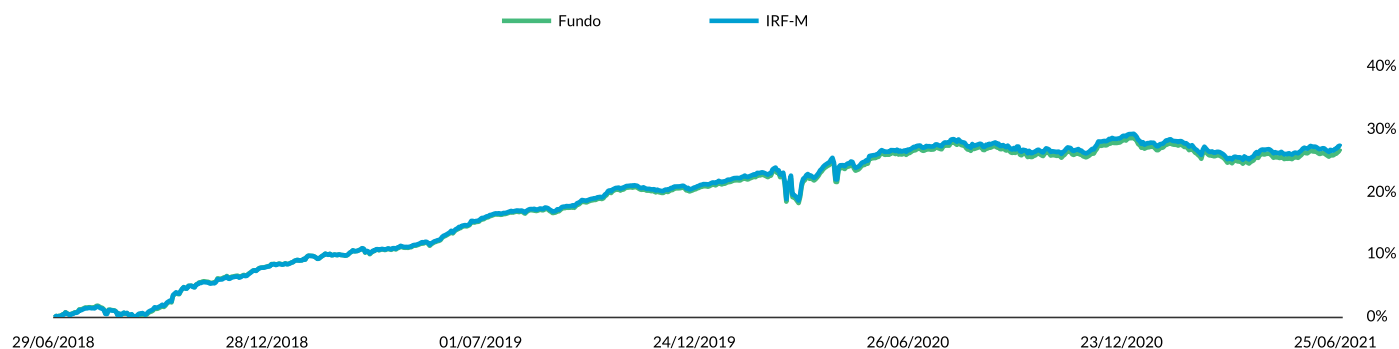
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,35	0,28	0,55	0,56	1,73	2,15	1,09	0,20	1,42	1,69	-0,49	0,61	11,68
IRF-M	1,39	0,29	0,59	0,61	1,77	2,16	1,09	0,26	1,44	1,70	-0,46	0,62	12,03
% IRF-M	97,34	93,94	93,60	92,70	97,57	99,53	100,08	75,73	98,84	99,85	106,63	98,14	97,11

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,84	0,63	-0,11	1,13	1,40	0,77	1,09	-0,77	-0,61	-0,36	0,33	1,96	6,43
IRF-M	0,88	0,65	-0,11	1,15	1,42	0,79	1,08	-0,75	-0,56	-0,33	0,36	1,95	6,69
% IRF-M	95,50	97,21	106,02	98,19	98,38	97,69	100,50	102,68	109,35	109,32	91,30	100,38	96,06

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-0,77	-1,15	-0,89	0,78	0,17	0,32							-1,55
IRF-M	-0,80	-1,18	-0,84	0,84	0,20	0,35							-1,44
% IRF-M	96,08	97,81	105,26	92,35	85,09	91,32							107,55

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	1.698.051.460,37	86,92
Operações Compromissadas	255.251.106,06	13,07
Mercado Futuro - Posições compradas	226.822,52	0,01
Valores a receber	217.320,59	0,01
Disponibilidades	4.009,67	0,00
Mercado Futuro - Posições vendidas	-8.984,93	0,00
Valores a pagar	-65.088,07	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