

## ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

### DADOS CADASTRAIS

**Fundo:** 17.098.794/0001-70 - Caixa FII Rio Bravo CXRI11

**Segmento:** Renda Variável

**Tipo de Ativo:** FI Imobiliários - Art. 8º, IV, b

**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\$):** 10.000,00

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

**Data de Início:** 17/10/2013

**Índice de Referência:** Não possui

**Carência:** Não há

**Prazo de Resgate:** D+2

**Categoria de Investidor:** Geral

**Taxa de Saída:** 0,00

**Taxa de Administração:** 1,20%

**Taxa de Performance:** Não há

**Investe em cotas de outros fundos:** Não

**Possui ativos de Emissores Privados:** Sim

Sim - Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira

Não - 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**

Investimentos imobiliários mediante a aquisição de Ativos, com foco em Cotas de FII. 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+2.

### **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 2 outros fundos, de mesmo benchmark (IFIX) e enquadramento (8º, IV, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 1,20%, ficou acima da média de 0,72% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de -90,45%, performou abaixo da média de -29,63%. Base de comparação:

08.924.783/0001-01 - BTG Pactual FII Corporate Office Fund BR CR11 - Tx Adm: 0,25 - Rent 12M: 1,36

03.683.056/0001-86 - Rio Bravo FII Renda Corporativa RCRB11 - Tx Adm: 0,70 - Rent 12M: 0,19

### **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 aos Cotistas obtenção de renda para o investimento realizado, por meio do fluxo de rendimentos gerado pelos Ativos e do aumento do valor patrimonial de suas Cotas. 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+2.

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

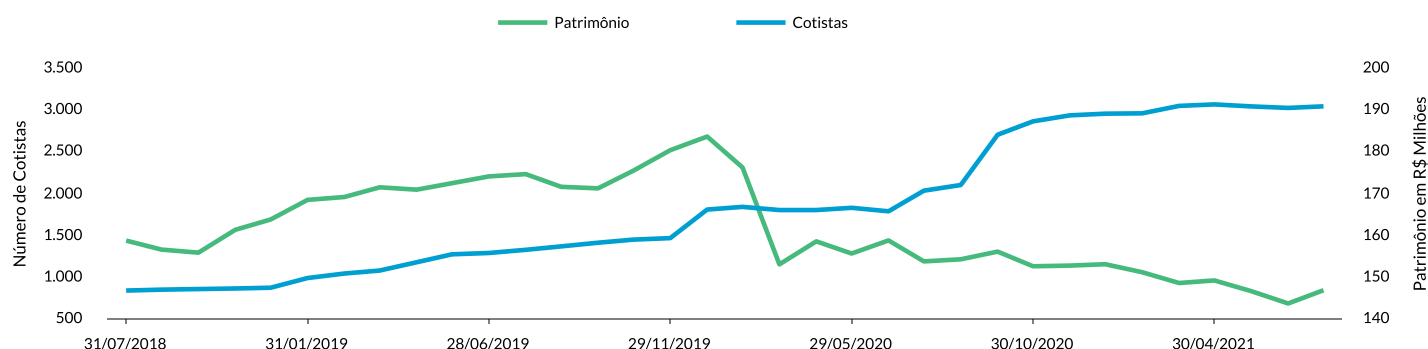
Foram observados 5 fundos da gestora 00.360.305/0001-04, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 01.525.057/0001-77, 01.165.780/0001-92, 68.623.479/0001-56, 13.767.159/0001-88, 16.676.620/0001-85. Em matéria de performance, 1 ficou acima do benchmark.

### **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**

Não se aplica.

## PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	146.942.178,56	3049
Médio em 12 meses	150.809.533,29	2820
Médio em 24 meses	159.565.302,29	2252

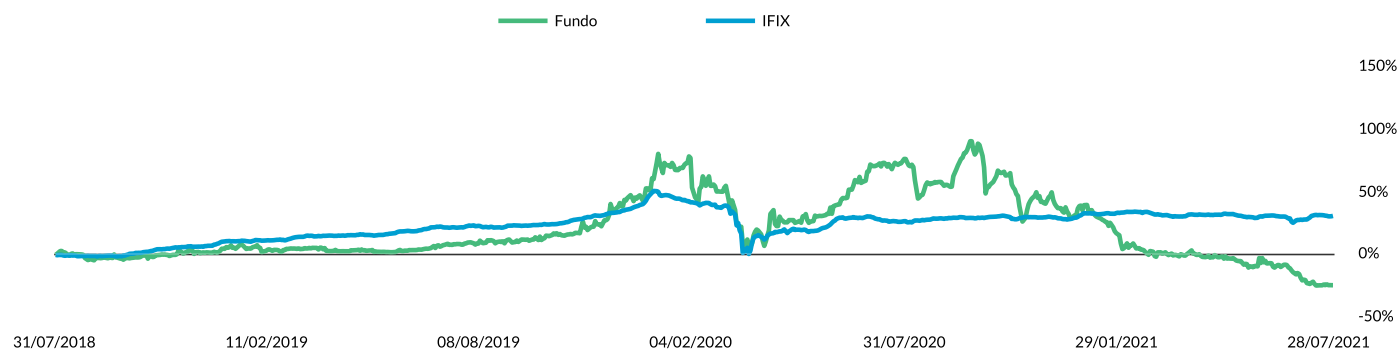
## RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	4,23	-1,42	-0,62	-1,16	0,29	1,78	4,31	1,85	1,19	7,57	13,48	9,96	48,67
IFIX	2,47	1,04	1,97	1,05	1,75	2,90	1,26	-0,11	1,05	3,99	3,55	10,62	35,98
≠ IFIX	1,77	-2,45	-2,59	-2,21	-1,46	-1,12	3,05	1,96	0,13	3,58	9,94	-0,66	12,68

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	17,45	-15,77	-20,62	6,97	3,87	20,00	10,90	-10,40	19,35	-19,46	-3,36	-4,97	-8,15
IFIX	-3,75	-3,70	-15,83	4,37	2,07	5,61	-2,60	1,79	0,43	-1,00	1,52	2,21	-10,23
≠ IFIX	21,20	-12,07	-4,80	2,60	1,80	14,39	13,50	-12,20	18,92	-18,45	-4,87	-7,17	2,07

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-16,62	-14,12	1,52	-4,51	-3,58	-8,55	-11,35						-45,74
IFIX	0,31	0,24	-1,39	0,53	-1,57	-2,20	2,32						-1,81
≠ IFIX	-16,93	-14,36	2,91	-5,04	-2,01	-6,35	-13,68						-43,92

## RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Cotas de Fundos	143.399.230,51	100,32
Disponibilidades	789.339,04	0,55
Valores a pagar	-1.250.043,37	-0,87

Obs.: Informações referentes à 30/06/2021.

## 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