

## ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

### DADOS CADASTRAIS

**Fundo:** 11.060.913/0001-10 - Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5

**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:** 09/07/2010

**Índice de Referência:** IMA-B 5

**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, pós fixadas e/ou índices de preços. 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 (IMA-B 5) e enquadramento (7°, I, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,20%, ficou abaixo da média de 0,23% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 5,77%, performou acima da média de 5,69%. Base de comparação:

13.455.117/0001-01 - Santander FIC Títulos Públicos IMA-B 5 - Tx Adm: 0,10 - Rent 12M: 5,83  
07.539.298/0001-51 - BTG Pactual Tesouro IPCA Curto Referenciado - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 5,81  
09.093.819/0001-15 - Itaú FIC Institucional IMA-B 5 - Tx Adm: 0,18 - Rent 12M: 5,81  
03.543.447/0001-03 - BB FIC Previdenciário IMA-B 5 - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 5,78  
12.672.120/0001-14 - Daycoval IMA-B 5 - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 5,14

### **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 IMA-B 5, 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.

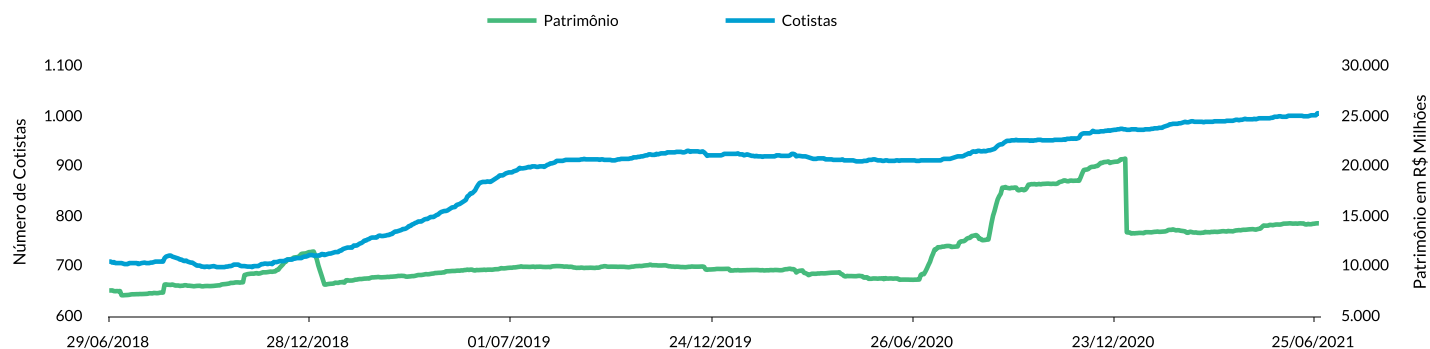
### **Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos**

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, nenhum 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	14.363.834.668,17	1007
Médio em 12 meses	15.058.227.803,39	967
Médio em 24 meses	12.372.553.378,29	942

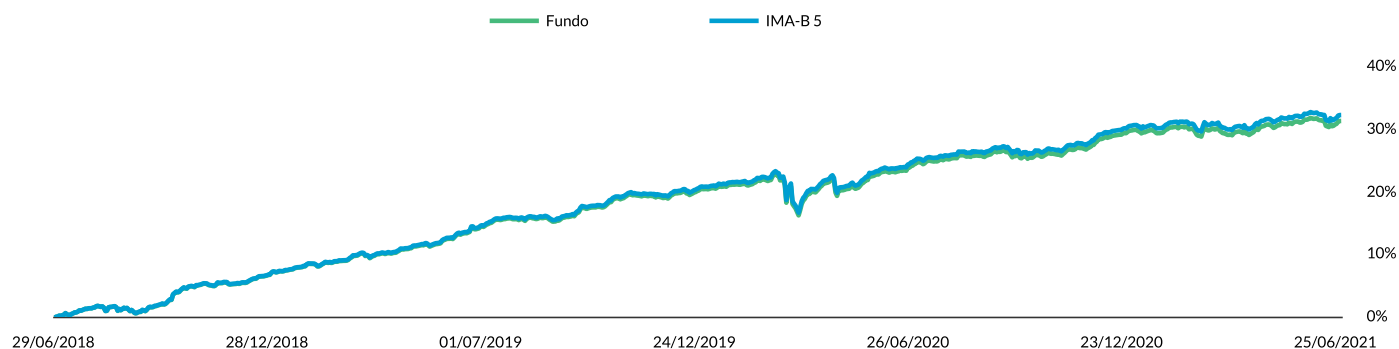
## RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,53	0,52	0,76	1,08	1,37	1,70	0,95	0,03	1,72	1,64	-0,34	1,21	12,85
IMA-B 5	1,54	0,55	0,78	1,11	1,39	1,72	0,97	0,05	1,74	1,65	-0,28	1,24	13,15
% IMA-B 5	99,57	95,90	97,45	97,51	98,91	98,97	97,24	70,14	98,89	99,22	119,38	97,64	97,72

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,54	0,63	-1,80	0,47	2,11	1,10	0,97	0,39	-0,16	0,18	1,29	1,82	7,75
IMA-B 5	0,56	0,64	-1,75	0,49	2,12	1,12	0,99	0,43	-0,12	0,20	1,32	1,83	8,04
% IMA-B 5	97,77	98,06	102,41	95,31	99,29	98,36	98,37	91,89	128,94	90,19	97,58	99,46	96,37

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,08	-0,62	0,31	0,86	0,67	-0,15							1,15
IMA-B 5	0,11	-0,60	0,34	0,87	0,69	-0,14							1,28
% IMA-B 5	78,61	103,87	90,79	98,55	97,00	113,65							89,80

## RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	13.164.528.362,99	97,14
Operações Compromissadas	387.262.430,56	2,86
Valores a pagar	-205.085,53	0,00
Mercado Futuro - Posições compradas	59.833,27	0,00
Valores a receber	59.833,27	0,00
Disponibilidades	3.855,29	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