

## ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

### DADOS CADASTRAIS

**Fundo:** 10.740.658/0001-93 - Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B

**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:** 08/03/2010

**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:** 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) e enquadramento (7º, 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 7,19%, performou acima da média de 7,07%. Base de comparação:

09.326.708/0001-01 - Sul América Inflatie - Tx Adm: 0,40 - Rent 12M: 7,76

07.442.078/0001-05 - BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 7,15

10.474.513/0001-98 - Itaú FIC Institucional Inflação - Tx Adm: 0,18 - Rent 12M: 7,12

09.814.233/0001-00 - BTG Pactual Tesouro IPCA Geral Referenciado - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 6,91

08.266.261/0001-60 - BNB IMA-B - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 6,28

### **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, 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.

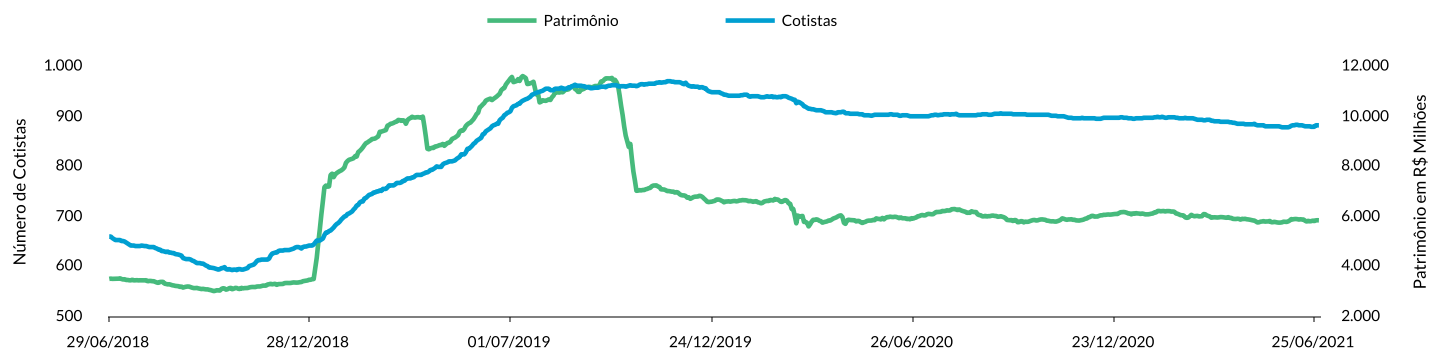
### **Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos**

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	5.867.854.510,24	883
Médio em 12 meses	6.005.860.882,28	896
Médio em 24 meses	6.911.747.011,05	918

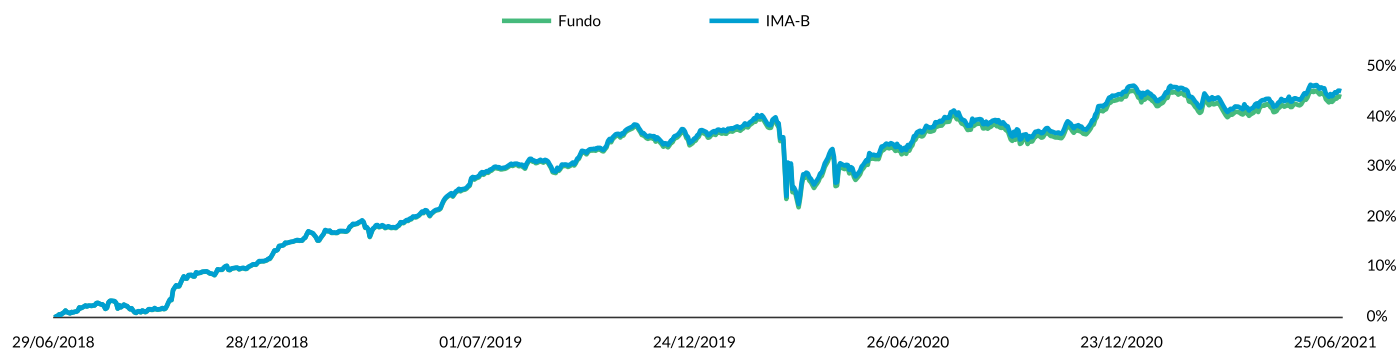
## RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	4,39	0,52	0,56	1,49	3,63	3,69	1,27	-0,42	2,85	3,33	-2,54	1,99	22,59
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	100,64	94,70	96,59	98,90	99,16	98,92	98,95	105,26	99,64	98,89	103,65	99,25	98,43

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,25	0,44	-7,10	1,30	1,50	2,03	4,38	-1,83	-1,53	0,19	1,99	4,84	6,06
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	94,38	97,67	101,86	99,16	98,83	98,88	99,75	101,83	101,42	91,31	99,44	99,73	94,63

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-0,87	-1,54	-0,47	0,63	1,04	0,47							-0,77
IMA-B	-0,85	-1,52	-0,46	0,65	1,06	0,49							-0,66
% IMA-B	102,47	101,57	102,99	96,80	98,54	96,34							117,06

## RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	5.676.370.823,04	94,66
Operações Compromissadas	319.936.571,30	5,34
Mercado Futuro - Posições compradas	109.771,04	0,00
Valores a receber	109.771,05	0,00
Valores a pagar	-70.710,61	0,00
Disponibilidades	3.173,75	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