

ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 10.577.519/0001-90 - Caixa Brasil Títulos Públicos IRF-M 1+

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: 11/05/2012

Índice de Referência: IRF-M 1+

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 outro fundo, de mesmo benchmark (IRF-M 1+) e enquadramento (7°, I, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,20%, ficou abaixo da média de 0,25% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de -1,30%, performou acima da média de -1,33%. Base de comparação:

32.161.826/0001-29 - BB Previdenciário IRF-M 1+ - Tx Adm: 0,30 - Rent 12M: -1,37

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 1+, 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.

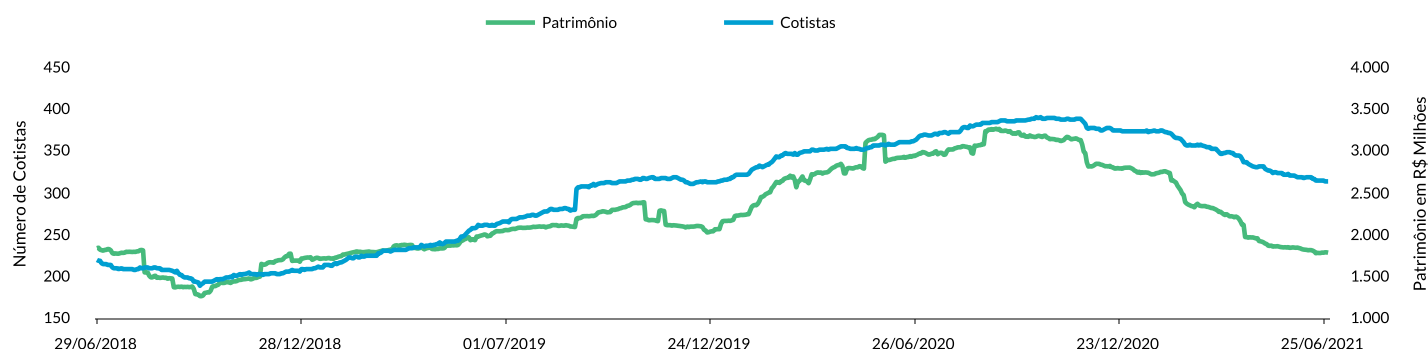
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

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	1.796.288.008,02	315
Médio em 12 meses	2.660.368.623,32	365
Médio em 24 meses	2.542.692.184,19	344

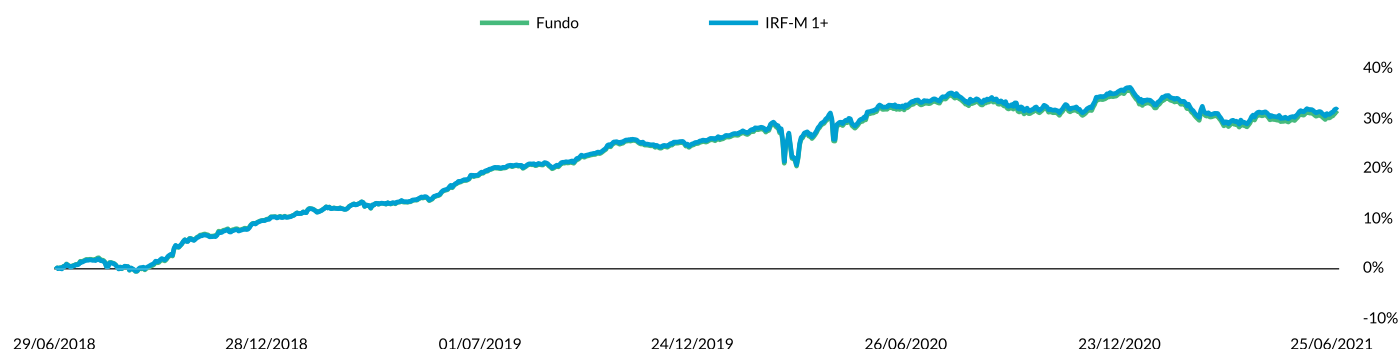
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,66	0,21	0,59	0,59	2,12	2,71	1,28	0,05	1,85	2,22	-0,85	0,70	13,89
IRF-M 1+	1,71	0,23	0,63	0,65	2,17	2,72	1,27	0,10	1,87	2,22	-0,83	0,72	14,24
% IRF-M 1+	97,12	92,44	93,97	91,17	97,83	99,75	100,77	45,71	99,09	100,01	101,68	97,41	97,54

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,08	0,78	-0,45	1,44	1,89	1,02	1,50	-1,18	-0,98	-0,56	0,43	3,04	8,22
IRF-M 1+	1,11	0,80	-0,47	1,50	1,92	1,04	1,47	-1,13	-0,91	-0,61	0,46	3,05	8,45
% IRF-M 1+	96,52	97,35	94,15	96,07	98,29	98,01	101,92	104,13	107,05	92,43	94,12	99,57	97,18

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-1,39	-1,99	-1,49	1,11	0,15	0,37							-3,23
IRF-M 1+	-1,39	-2,01	-1,45	1,12	0,20	0,42							-3,11
% IRF-M 1+	99,86	98,88	102,71	98,36	73,51	90,17							103,94

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	1.752.656.719,56	77,64
Operações Compromissadas	504.037.154,77	22,33
Mercado Futuro - Posições compradas	373.478,93	0,02
Valores a receber	373.245,08	0,02
Disponibilidades	4.115,70	0,00
Valores a pagar	-43.719,40	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