

## ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

### DADOS CADASTRAIS

**Fundo:** 03.737.188/0001-43 - Caixa Multimercado RV 30

**Segmento:** Renda Variável

**Tipo de Ativo:** FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III

**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\$):** 0,00

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

**Data de Início:** 20/06/2000

**Índice de Referência:** CDI

**Carência:** Não há

**Prazo de Resgate:** D+3

**Categoria de Investidor:** Geral

**Taxa de Saída:** 0,00

**Taxa de Administração:** 1,00%

**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 diversificada de ativos financeiros, no âmbito do mercado financeiro e de capitais nacional e internacional, estando exposto aos riscos das variações das taxas de juros prefixadas ou pós-fixadas (SELIC/CDI), índices de inflação e/ou preços, commodities, variação cambial e de preços das ações ou índices do mercado acionário ou todos, não havendo, necessariamente, um fator de risco principal. 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+3.

### **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 (CDI) e enquadramento (8°, III) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 1,00%, ficou acima da média de 0,76% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 4,78%, performou acima da média de 2,47%. Base de comparação:

00.836.263/0001-35 - Votorantim Eagle Crédito Privado Multimercado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 2,88

01.541.649/0001-82 - Bradesco FIC Golden Profit Conservador Mult. - Tx Adm: 1,20 - Rent 12M: 2,56

00.973.117/0001-51 - Itaú FIC Juros e Moedas Institucional Mult. - Tx Adm: 0,35 - Rent 12M: 2,40

02.998.164/0001-85 - Bradesco Plus I Multimercado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 1,82

01.606.543/0001-10 - Bradesco FIC Alocação Moderada Multimercado - Tx Adm: 1,00 - Rent 12M: 0,41

### **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 buscar rentabilidade por meio de carteira diversificada de ativos financeiros do mercado nacional e internacional. 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+3.

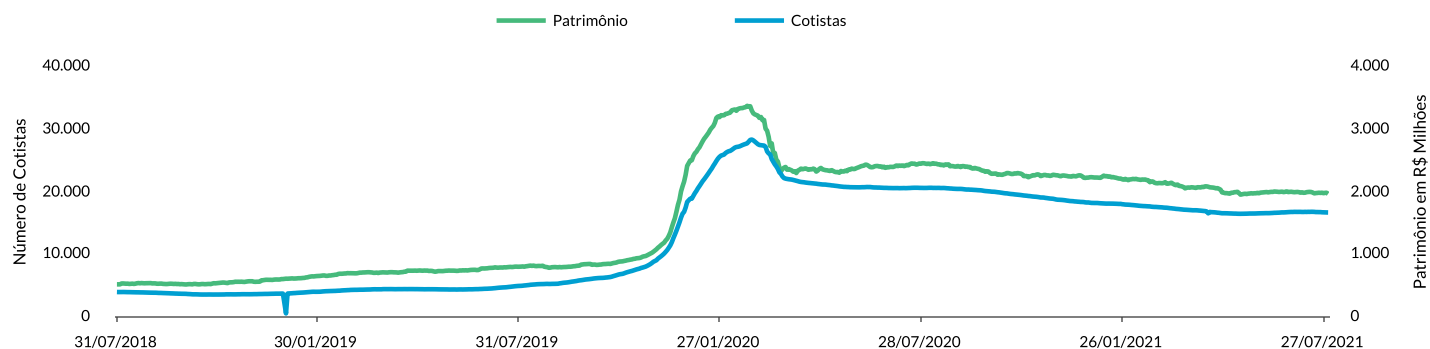
### **Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos**

Foram observados 5 fundos da gestora 00.360.305/0001-04 - Caixa Econômica Federal, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 14.239.657/0001-10, 14.239.659/0001-00, 08.070.841/0001-87, 14.120.520/0001-42, 18.007.358/0001-01. Em matéria de performance, 3 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	1.969.915.384,85	16719
Médio em 12 meses	2.177.524.772,90	18177
Médio em 24 meses	2.062.037.568,39	17228

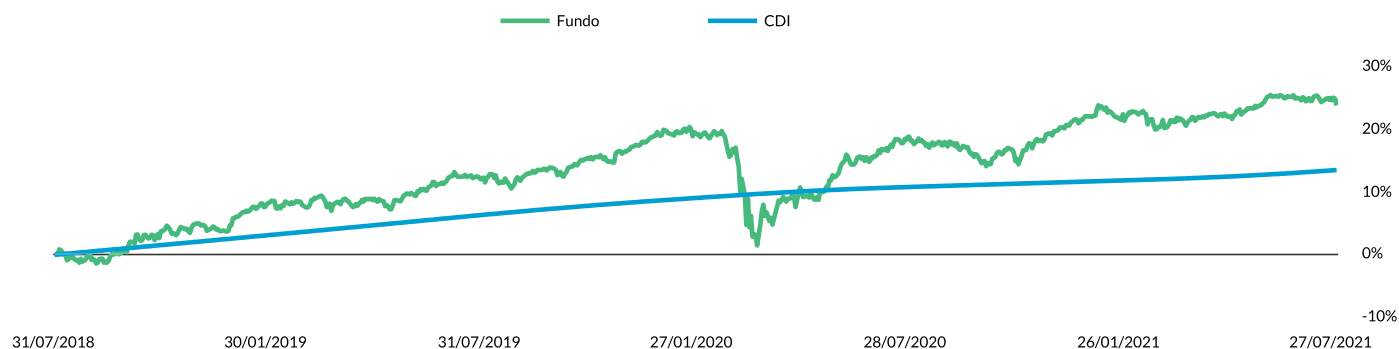
## RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	3,38	-0,31	0,23	0,74	0,70	1,49	0,62	0,29	1,32	1,19	1,10	2,22	13,70
CDI	0,54	0,49	0,47	0,52	0,54	0,47	0,57	0,50	0,47	0,48	0,38	0,38	5,97
% CDI	621,82	-62,92	48,72	141,82	128,12	317,08	109,60	58,50	283,92	247,53	289,29	589,73	229,62

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-0,25	-2,41	-8,45	3,40	2,49	2,60	2,44	-0,78	-2,05	-0,38	4,02	2,56	2,52
CDI	0,38	0,29	0,34	0,28	0,24	0,22	0,19	0,16	0,16	0,16	0,15	0,16	2,77
% CDI	-66,35	-817,88	-2.482	1.192	1.042	1.208	1.254	-481,97	-1.309	-239,51	2.687	1.557	91,13

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-0,58	-1,13	1,58	0,13	1,91	0,39	0,04						2,33
CDI	0,15	0,13	0,20	0,21	0,27	0,30	0,34						1,61
% CDI	-387,50	-843,48	797,34	64,31	714,37	129,43	11,81						144,63

## RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	1.529.372.171,89	77,21
Operações Compromissadas	413.042.083,49	20,85
Ações	42.772.127,34	2,16
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	6.500.675,00	0,33
Valores a receber	2.336.290,17	0,12
Opções - Posições titulares	666.577,94	0,03
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	392.010,53	0,02
Mercado Futuro - Posições vendidas	117.107,07	0,01
Disponibilidades	1.000,00	0,00
Opções - Posições lançadas	-366.694,68	-0,02
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	-469.886,65	-0,02
Mercado Futuro - Posições compradas	-4.143.810,93	-0,21
Valores a pagar	-9.460.325,29	-0,48

Obs.: Informações referentes à 30/04/2021.

## ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

Ao assinar o Credenciamento, os responsáveis atestam que:

- 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;
- 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.
- 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