

ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 30.068.224/0001-04 - Caixa FIC FIA Multigestor

Segmento: Renda Variável

Tipo de Ativo: FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a

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\$): 1.000,00

Data de Início: 25/06/2019

Carência: Não há

Categoria de Investidor: Geral

Taxa de Administração: 1,50%

Taxa de Performance: Não há

Aplicação Adicional Mínima (R\$): 100,00

Índice de Referência: Ibovespa

Prazo de Resgate: D+25

Taxa de Saída: 0,00

Investe em cotas de outros fundos: Sim

34.659.901/0001-01 – Renda Variável – 8º, II, a – 9,76%
14.866.273/0001-28 – Renda Variável – 8º, II, a – 9,07%
11.392.165/0001-72 – Renda Variável – 8º, II, a – 8,97%
35.502.481/0001-18 – Renda Variável – 8º, I, a – 8,06%
15.569.128/0001-48 – Renda Variável – 8º, II, a – 8,03%
28.470.587/0001-11 – Renda Variável – 8º, II, a – 7,96%
35.828.712/0001-88 – Renda Variável – 8º, I, a – 7,46%
17.898.650/0001-07 – Renda Variável – 8º, II, a – 7,10%
26.768.800/0001-40 – Renda Variável – 8º, II, a – 6,97%
31.533.338/0001-32 – Renda Variável – 8º, II, a – 6,46%
38.248.976/0001-50 – Renda Variável – 8º, I, a – 5,71%
11.403.850/0001-57 – Renda Variável – 8º, II, a – 4,73%
11.182.064/0001-77 – Renda Variável – 8º, II, a – 4,71%
15.862.830/0001-03 – Renda Variável – 8º, II, a – 2,92%
05.164.353/0001-40 – Renda Fixa – 7º, I, b – 1,70%

Obs.: Informações referentes à 30/07/2021.

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 os recursos em cotas de fundos de investimento geridos por gestores distintos, que invistam em ativos financeiros e modalidades operacionais conforme a regulamentação em vigor, e dentro dos limites estabelecidos em sua política de investimento, expostos diretamente, ou através do uso de derivativos, aos riscos de investimento no exterior, preços das ações e/ou índices do mercado acionário. 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+25.

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 (Ibovespa) e enquadramento (8º, II, a) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 1,50%, ficou abaixo da média de 2,12% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 11,43%, performou abaixo da média de 13,70%. Base de comparação:

02.444.266/0001-59 - Set FIA - Tx Adm: 1,80 - Rent 12M: 19,22

03.660.879/0001-96 - Bradesco FIA Selection - Tx Adm: 1,50 - Rent 12M: 16,66

01.675.497/0001-00 - Geração Futuro FIA - Tx Adm: 3,00 - Rent 12M: 13,11

03.168.062/0001-03 - ARX FIC FIA Income - Tx Adm: 2,94 - Rent 12M: 11,85

02.436.763/0001-05 - Santander FIC Seleção Top Ações - Tx Adm: 2,00 - Rent 12M: 9,91

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

Busca a valorização das cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas de fundos de investimento, que invistam em ativos financeiros e modalidades operacionais conforme a regulamentação em vigor, e dentro dos limites estabelecidos em sua política de investimento. 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+25.

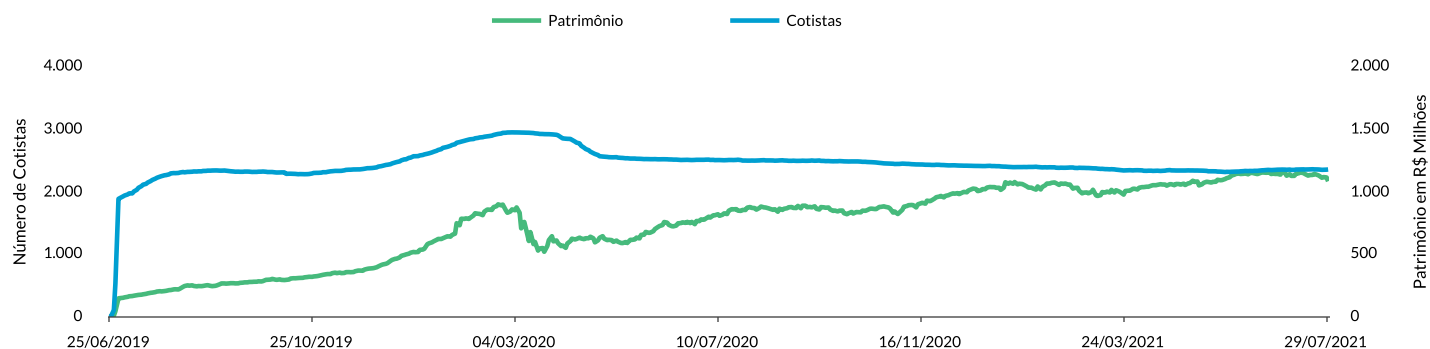
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foram observados 5 fundos da gestora 00.360.305/0001-04 - Caixa Econômica Federal, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 04.885.820/0001-69, 03.737.217/0001-77, 08.046.355/0001-23, 01.525.057/0001-77, 05.900.798/0001-41. Em matéria de performance, 2 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

O gestor é responsável pela aplicação dos fundos Master, de acordo com as normas estabelecidas no Regulamento do Fundo. Na data de análise o fundo está aplicando em fundos enquadrados pela CMN.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



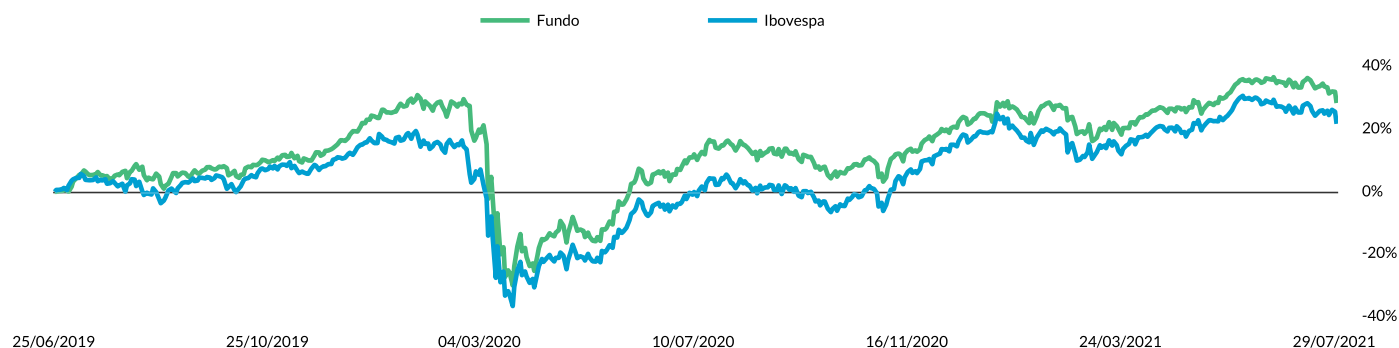
PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	1.084.997.968,28	2359
Médio em 12 meses	1.000.881.031,72	2404
Médio em 24 meses	772.403.271,00	2473

RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	3,17	-8,78	-31,94	12,64	7,64	9,88	9,22	-3,45	-5,38	-1,91	12,53	7,65	1,18
Ibovespa	-1,63	-8,43	-29,90	10,25	8,57	8,76	8,27	-3,44	-4,80	-0,69	15,90	9,30	2,92
≠ Ibovespa	4,80	-0,35	-2,03	2,39	-0,93	1,12	0,96	-0,01	-0,58	-1,22	-3,37	-1,65	-1,74

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-2,57	-2,79	3,18	3,35	5,02	1,66	-2,15						5,51
Ibovespa	-3,32	-4,37	6,00	1,94	6,16	0,46	-0,89						5,59
≠ Ibovespa	0,75	1,59	-2,82	1,41	-1,13	1,19	-1,26						-0,08

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Cotas de Fundos	1.086.984.775,35	99,62
Valores a receber	8.444.973,95	0,77
Disponibilidades	0,00	0,00
Valores a pagar	-4.263.774,18	-0,39

Obs.: Informações referentes à 30/07/2021.

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