|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[[1]](#footnote-1)**  **(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)** | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Nome Fundo** | | | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | | | | | | | | | | | | CNPJ: 14.386.926/0001-71 | | |
| **Administrador** | | | Caixa Econômica Federal | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | | 08/2020 | CNPJ: 00.360.305/0001-04 | | |
| **Gestor** | | | Caixa Econômica Federal | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | | 08/2020 | CNPJ: 00.360.305/0001-04 | | |
| **Custodiante** | | | Caixa Econômica Federal | | | | | | | | | | | | CNPJ: 00.360.305/0001-04 | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010** | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | Art. 7º, I, “b” | | | | | | | |  | | Art. 8º, I,“b” | | | | | | |
|  | Art. 7º, I,“c” | | | | | | | |  | | Art. 8º, II,“a” | | | | | | |
|  | Art. 7º, III,“a” | | | | | | | |  | | Art. 8º, II,“b” | | | | | | |
|  | Art. 7º, III,“b” | | | | | | | |  | | Art. 8º, III | | | | | | |
|  | Art. 7º, IV,“a” | | | | | | | |  | | Art. 8º, IV,“a” | | | | | | |
|  | Art. 7º, IV,“b” | | | | | | | |  | | Art. 8º, IV,“b” | | | | | | |
|  | Art. 7º, VII,“a” | | | | | | | |  | | Art. 8º, IV,“c” | | | | | | |
|  | Art. 7º, VII,“b” | | | | | | | |  | | Art. 9º-A, I | | | | | | |
|  | Art. 7º, VII,“c” | | | | | | | |  | | Art. 9º-A, II | | | | | | |
|  | Art. 8º, I,“a” | | | | | | | |  | | Art. 9º-A, III | | | | | | |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | **Identificação dos documentos analisados referentes ao Fundo:** | **Data do doc.** | **Página na internet em que o documento foi consultado ou disponibilizado pela instituição** | | *1. Questionário Padrão Due Diligence para Fundo de Investimento – Seção 2 da ANBIMA* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | *2. Regulamento* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | *3. Lâmina de Informações essenciais* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | *4. Formulário de informações complementares* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | *5. Perfil Mensal* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | *6. Demonstração de Desempenho* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | *7. Relatórios de Rating* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | *8. Demonstrações Contábeis* |  | *http://www.caixa.gov.br* | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **II.5 - Forma de Distribuição do Fundo** (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011) | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Nome/Razão Social do distribuidor: | | | | | | | Caixa Econômica Federal | | | | | | | | | | |
| CPF/CNPJ: | | | | | | | 00.360.305/0001-04 | | | | | | | | | | |
| Informações sobre a Política de Distribuição: | | | | | | | A distribuição dos Fundos de Investimento é realizada exclusivamente pelo Caixa Econômica Federal, por meio de suas agências e canais digitais. | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Resumo das informações do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Data de Constituição: | | | | | | 13/09/2011 | | | | Data de Início das Atividades: | | | | | 16/08/2012 | | |
| Política de Investimentos do Fundo | | | | | | Índice de referência/objetivo de rentabilidade: IDkA IPCA 2 Anos | | | | | | | | | | | |
| Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços. | | | | | | | | | | | |
| Público-alvo: | | | | | | Exclusivo previdenciário | | | | | | | | | | | |
| Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate) | | | | | | Prazo de Duração do Fundo | | | | | | | | | Indeterminado | | |
| Prazo de Carência (dias) | | | | | | | | | NA | | |
| Prazo para Conversão de Cotas (dias) | | | | | | | | | D+0 | | |
| Prazo para Pagamento dos Resgates (dias) | | | | | | | | | D+0 | | |
| Prazo Total (dias) | | | | | | | | | NA | | |
| Condições de Investimento (Custos/Taxas) | | | | | | Taxa de entrada (%) | | | | | | | | | NA | | |
| Taxa de saída (%) | | | | | | | | | NA | | |
| Taxa de administração (%) | | | | | | | | | 0,20% | | |
| Taxa de Performance | | | | | | | | | | | |
| Índice de referencia | | | Frequência | | | | | | | Linha-d`água | |
| NA | | | NA | | | | | | | NA | |
| Aderência do Fundo aos quesitos estabelecidos na Resolução do CMN relativos, dentre outros, aos gestores e administradores do fundo, aos ativos de crédito privado que compõem sua carteira | | | | | | Fundo enquadrado na Resolução CMN nº 3.922/2010 e alterações posteriores | | | | | | | | | | | |
| Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo: | | | | | | NA | | | | | | | | | | | |
| Análise de fatos relevantes divulgados: | | | | | | NA | | | | | | | | | | | |
| Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos: | | | | | | NA | | | | | | | | | | | |
| Principais riscos associados ao Fundo: | | | | | | RISCO DE MERCADO; RISCO DE LIQUIDEZ; RISCO DE CRÉDITO, RISCO DERIVATIVOS; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento). | | | | | | | | | | | |
| **Histórico de Rentabilidade do Fundo** | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Ano** | | **Nº de Cotistas** | | **Patrimônio Líquido**  **(R$)** | | | | **Valor da**  **Cota do Fundo**  **(R$)** | | | | | **Rentabilidade**  **(%)** | **Variação % do índice de referência** | | **Contribuição em relação ao índice de referência/ ou**  **Desempenho do fundo como % do índice de referência** | |
| **2019** | | 964 | | R$ 8.750.821.084,96 | | | | 2,218947 | | | | | 11,19% | - | | - | |
| **2018** | | 732 | | R$ 7.593.758.539,71 | | | | 1,99566800 | | | | | 9,30% | 9,75% | | 95,38% | |
| **2017** | | 619 | | R$ 4.324.047.951,59 | | | | 1,82581300 | | | | | 12,34% | 13,61% | | 90,67% | |
| **2016** | | 620 | | R$ 3.699.856.942,99 | | | | 1,62523400 | | | | | 14,94% | 15,21% | | 98,22% | |
| **2015** | | 473 | | R$ 2.427.609.953,99 | | | | 1,41395100 | | | | | 15,50% | 16,38% | | 94,60% | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Análise da Carteira do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Composição da carteira (atual)** | | | | **Espécie de ativos** | | | | | | | | | | | | | **% do PL** |
| Títulos Federais | | | | | | | | | | | | | 98,6174% |
| Operação compromissada | | | | | | | | | | | | | 1,3880% |
| Valores a pagar/receber | | | | | | | | | | | | | -0,0039% |
|  | | | | | | | | | | | | |  |
|  | | | | | | | | | | | | |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento** | | | | CNPJ Fundo(s) | | | | | Classificação Resolução CMN | | | | | | | | % do PL |
| 1. NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| 1. NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| 1. NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| ..... | | | | |  | | | | | | | |  |
| **Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo** | | | | Emissor (CPF/CNPJ) | | | | | Tipo de Emissor | | | | | | | | % do PL |
| NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| NA | | | | | NA | | | | | | | | NA |
| Carteira do Fundo é aderente à Política de Investimentos estabelecida em seu regulamento e com a classificação na Resolução CMN | | | | | | | | | SIM | | | | | | | | |
| Prazo médio da carteira de títulos do Fundo (em meses (30) dias) | | | | | | | | | | | | | | 24 | | | |
| Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS | | | | | | | | | Compatível | | | | | | | | |
| **Nota de Risco de Crédito** | | | | | **Agência de risco** | | | | | | | | | | **Nota** | | |
| NA | | | | | | | | | | NA | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:** | | | | | Fundo apto e em conformidade aos ativos disponível no mercado com o mesmo objetivo | | | | | | | | | | | | |
| **Comentários Adicionais** | | | | | Obter rentabilidade compatível com a variação do IDKA IPCA 2A. | | | | | | | | | | | | |

**Declaro que tenho 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.**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Data:** | | **11/12/2020** | |
| **Responsáveis pela Análise:** | **Cargo** | **CPF** | **Assinatura** |
| **Luís Antônio Kleinübing** | **Presidente** | **539.326.920-04** |  |
| **Luciane Vogt** | **Gestor** | **885.700.290-04** |  |
| **Walter Dreyer** | **Membro do Comitê de Investimentos** | **394.013.320-53** |  |
| **Júlia Dezingrini** | **Membro do Comitê de Investimentos** | **539.664.730-20** |  |

1. [↑](#footnote-ref-1)