|  |
| --- |
| **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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | CNPJ: 11.060.913/0001-10 |
| **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: | 09/07/2010 | Data de Início das Atividades: | 09/07/2010 |
| Política de Investimentos do Fundo | Índice de referência/objetivo de rentabilidade: IMA-B 5 |
| Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5. |
| 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** | 923 | 9.819.854.122,58 | 2,996681 | 12,85% | - | - |
| **2018** | 724 | 11.498.930.142,73 | 2,65534200 | 9,67% | 9,87% | 97,99% |
| **2017** | 703 | 6.666.405.048,53 | 2,42126500 | 12,38% | 12,58% | 98,44% |
| **2016** | 713 | 5.450.485.822,27 | 2,15450300 | 15,19% | 15,48% | 98,12% |
| **2015** | 631 | 3.791.382.507,35 | 1,87037300 | 14,86% | 15,46% | 96,15% |
|  |
|  **Análise da Carteira do Fundo de Investimento** |
| **Composição da carteira (atual)** | **Espécie de ativos** | **% do PL** |
| Títulos Federais | 96,2117% |
| Operação compromissada | 3,7925% |
| Valores a pagar/receber | 0,00% |
|  |  |
|  |  |
|  |
| **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) | 32 |
| 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** | Proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas. |

**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)