

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

(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 TÍTULO PÚBLICO				
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	C0117003	CNPJ	11.060.913/0001-10
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	C0117003	CNPJ	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 4.604/2017:

X	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 Documento	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	31/12/2018	Disponibilizado pela Instituição.
2. Regulamento	17/10/2019	http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
3. Lâmina de Informações essenciais	02/2020	http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
4. Formulário de informações complementares	14/09/2018	http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
5. Perfil Mensal	02/2020	http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
6. Demonstração de Desempenho	Referente a Dez/2019	http://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/renda-fixa/fi-brasil-ima-b-5-titulos-publicos-ri-longo-prazo/Paginas/default.aspx
7. Relatórios de Rating	Não Disponibilizado pela Instituição	Não Disponibilizado pela Instituição
8. Demonstrações Contábeis	31/12/2019	http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg

Plano

Boat

X

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: Eventuais resultados relativos a ativos componentes da carteira do FUNDO serão incorporados ao seu respectivo patrimônio, quando do seu pagamento ou distribuição pelos emissores de tais ativos.

Resumo das Informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	30/07/2009	Data de Início das Atividades:	09/07/2010
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice do Índice de Mercado ANBIMA - série B 5 - IMA-B 5, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.		
Público-alvo:	Regimes Próprios de Previdência Social		
Condições de Investimento (Prazos/Condições para resgate)	Prazo de Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de Carência (dias)	0	
	Prazo para Conversão de Cotas (dias)	0	
	Prazo para Pagamento dos Resgates (dias)	0	
	Prazo Total (dias)	0	
	Taxa de entrada (%)	0	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de saída (%)	0	
	Taxa de Administração (%)	0,20% a.a.	
	Taxa de Performance		
	Índice de referência	Frequência	Linha-d'água
Não Possui		Não se aplica	

Handwritten signatures and initials:



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	Nos últimos dois anos, o fundo de investimento rentabilizou 23,77%, enquanto seu benchmark rentabilizou no mesmo período 24,31%, se mostrando aderente ao seu Benchmark. O fundo não possui prazo de carência, mostrando compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do RPPS. O Índice de liquidez do Fundo foi obtido por meio do somatório dos índices de liquidez apurados para cada ativo ou grupo de ativos financeiros.
Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo:	Não Houve
Análise de fatos relevantes divulgados:	Não Houve
Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos:	O fundo se encontra aderente ao perfil da carteira e a Política de Investimentos do RPPS.
Principais riscos associados ao Fundo:	Risco de Mercado; Risco de Crédito; Risco de Liquidez; Risco de Concentração; Risco Sistemico e de Regulação e Risco Proveniente do uso de Derivativos.

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (R\$)	Valor da Cota do Fundo (R\$)	Rentabilidade (%)	Varição % do índice de referência	Contribuição em relação ao índice de referência ou desempenho do fundo como % do índice de referência
2019	923	R\$ 9.819.854.122,58	2,996681	12,86%	13,15%	97,72%
2018	724	R\$ 11.498.930.142,73	2,655342	9,67%	9,87%	97,99%
2017	703	R\$ 6.666.405.048,53	2,421265	12,38%	12,58%	98,44%
2016	713	R\$ 5.450.485.822,27	2,154503	15,19%	15,48%	98,12%
2015	631	R\$ 3.791.382.507,35	1,870373	14,86%	15,46%	96,15%

Paula - Abril

X

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Análise da Carteira do Fundo de Investimento				
Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos			% do PL
	Títulos Públicos Federais			96,21%
	Operações Compromissadas			3,79%
				-
				-
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL	
	N/A	N/A	N/A	
	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	Emissor (CPF/CNPJ)	Classificação Resolução CMN	% do PL	
	-	-	-	
Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
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)		22		
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS		O fundo não possui prazo de carência, mostrando compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do RPPS.		

[Assinatura]

[Assinatura]

[Assinatura]

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco		Nota Forte
	Fitch Rating		
Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo analisado possui características de acordo com a Política de Investimentos do RPPS e sua compatibilidade ao perfil da carteira comparado com os demais fundos distribuídos no mercado, com os mesmo índice de Benchmark.		
Comentários Adicionais	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.		
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:		18/03/2020	
Responsáveis pela Análise:	Cargo	CPF	Assinatura
DOMINGOS RAMOS DE OLIVEIRA SOUZA	Superintendente e Gestor de Investimentos	979.033.967-49	
LIENE LANGA MOURA	Membro do Comitê de Investimentos	841.041.397-34	
SEDRICK VASCONCELOS LOPES	Membro do Comitê de Investimentos	117.217.287-08	