

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	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP			
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	002	CNPJ 11.060.913/0001-10
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	002	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	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	17/10/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
3. Lâmina de Informações essenciais	12/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
4. Formulário de informações complementares	14/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
5. Perfil Mensal	12/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
6. Demonstração de Desempenho	Referente a 2020	

Praves

7. Relatórios de Rating		-		Não Disponibilizado pela Instituição.	
8. Demonstrações Contábeis		31/12/2019		https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg	
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 referencia/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	



Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada (%)			0
	Taxa de saída (%)			0
	Taxa de Administração (%)			0,20% a.a.
	Taxa de Performance			
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d'água	
Aderência do Fundo aos questionamentos estabelecidos na Resolução do CMN relativos, dentre outros, aos gestores e administradores do fundo, aos ativos de crédito privado que compõem sua carteira	Não Possui	Não se aplica	Não se aplica	
	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.			
	Não Houve			
	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.			

Planes

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
2020	976	R\$ 20.761.505.098,56	3,228834	7,75%	8,04%	96,37%
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%
Análise da Carteira do Fundo de Investimento						
Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos			% do PL		
	Títulos Públicos			97,68%		
	Operações Compromissadas			2,32%		
	-			-		
	-			-		
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ Fundo(s)		Classificação Resolução CMN		% do PL	
	-		-		-	
	-		-		-	
	-		-		-	
	-		-		-	

Plano

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Classificação Resolução CMN	% do PL
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
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)	Não Disponibilizado pela instituição.		
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.		
Nota de Risco de Crédito	Agência de risco		Nota
	Fitch Rating		Forte
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.		

W. P. Soares

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:

18/03/2021

Responsáveis pela Análise:	Cargo	CPF	Assinatura
Adelgino de Nascimento Siqueira	Presidente do Conselho de Administração	029.400.357-25	
Adelgino de Nascimento Siqueira	Membro do Conselho de Administração	088.064.177-03	
Edison Raimundo da Pa	Presidente Conselho Previdenciário	973.421.381-20	
Marcelo Souto Monteiro	Membro do Conselho de Administração	948.784.557-72	
Adelgino de Nascimento Siqueira	Membro do Conselho de Administração	103.958.067-75	
Deivid K. Vasconcelos de Aguiar	Membro Conselho de Investimentos	017.217.282-08	
Deivid K. Vasconcelos de Aguiar	Membro Conselho de Investimentos	8404139734	
Dominique KAMES OLIVEIRA	Presidente COMIT. INVEST.	099.033.967-43	

DATA em 07/06/2021


Domingos Raimundo de Oliveira Souza
Superintendente