LEMA
ECONOMIA & FINANÇAS

ANEXO A

CHECKLIST DE DOCUMENTAÇÃO PARA CREDENCIAMENTO

Como ferramenta de auxílio para o estágio de análise da documentação, o Manual de Credenciamento disponibiliza uma lista com a mínima documentação exigida para o rito de credenciamento da instituição financeira.

INSTITUIÇÃO: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

CNPJ: 00.360.305/0001-04

GESTOR (X) ADMINISTRADOR (X)

	DOCUMENTO ANALISADO	RECEBIDO	DATA	VALIDADE
1	Termo de Análise e Atestado de Credenciamento ou Questionário Due Diligence – Seção I (se for o caso)	OK	18/03/2021	18/03/2022
2	Anexo 1 - Análise de Fundos de Investimento ou Questionário Due Diligence – Seção II (se for o caso)	OK	18/03/2021	18/03/2022
3	Autorização BACEN/CVM	OK	-	-
4	Relatório de Rating (Boa Qualidade de Gestão)	OK	12/08/2020	12/08/2021
5	Certidão Negativa de Débitos Municipais	OK	21/12/2020	21/03/2021
6	Certidão Negativa de Débitos Estaduais	OK	21/12/2020	21/03/2021
7	Certidão Negativa de Débitos Federais	OK	17/12/2020	15/06/2021
8	Certidão quanto a Contribuições para o FGTS	OK	01/03/2021	19/03/2021

Com base no Manual de Credenciamento, a Instituição é considerada:

APTA (X) INAPTA ( ) relacionar-se com o RPPS.

Chorozinho, 18 de março de 2021.

Jorvas de Sousa Menezes
Gestor de Recursos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 1:

Informações Sobre a Empresa

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART – Vice Presidência Fundos de Investimento

Data:

30/06/2020

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Sumário

Apresentação **3**

1) Informações sobre a Empresa **4**

1 - Informações Cadastrais 4

2 - Informações Institucionais 4

3 - Números da Empresa 12

4 - Receitas da Empresa 14

5 - Recursos Humanos 14

6 - Informações Gerais 15

7 - Informações Operacionais 16

8 - Compliance e Auditoria Interna 24

9 - Questões Jurídicas e Legais 28

10 - Anexos 28

2) Declaração **29**

3) Eventos Importantes **30**

Atualizar Sumário .....

(Para atualizar o sumário, clique no texto acima com o botão direito, atualizar campo, atualizar apenas os números de página)

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimentos.

1) Informações sobre a Empresa

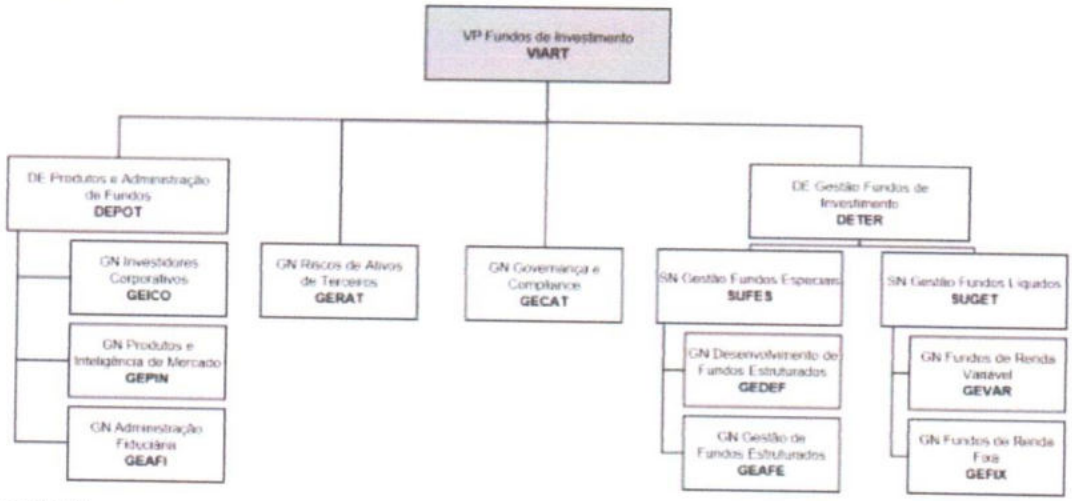
1 - Informações Cadastrais	
1.1	Razão Social
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	
1.2	Nome de fantasia
CAIXA	
1.3	Endereço
ST BANCARIO SUL QUADRA 04 – Nº 34 – BLOCO A – ASA SUL – BRASÍLIA/DF (Matriz)	
1.4	CNPJ
00.360.305/0001-04	
1.5	Data de constituição
12/01/1861	
1.6	Telefone
(11) 3572-4600	
1.7	Fax
1.8	Website
www.caixa.gov.br	
1.9	Quais são as autoridades regulatórias em que a empresa possui registro? Fornecer detalhes sobre os registros, tais como nome, data e nº de registro da atividade.
CVM - Ato Declaratório CVM nº 3.241, de 04 de janeiro de 1995.	
1.10	Membro de associações de classe? Quais?
Sim. A VIART é membro da ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais	
1.11	Nome de quem responde o questionário
GEICO - Gerência Nacional Investidores Corporativos e demais áreas da CAIXA de acordo com os mandatos e responsabilidades das unidades gestoras.	
1.12	Cargo
-	
1.13	Telefone para contato
(11) 3572-4600	
1.14	Fax
(11) 3572-4600	
1.15	E-mail para contato
geico@caixa.gov.br	
2 - Informações Institucionais	
2.1	Quadro societário: nomes dos principais sócios e respectivas participações (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3)
A Caixa Econômica Federal (CAIXA ou Instituição) é uma instituição financeira constituída pelo Decreto-Lei nº 759, de 12 de agosto de 1969, sob a forma de empresa pública com personalidade jurídica de direito privado, vinculada ao Ministério da Fazenda, com sede em Brasília – Distrito Federal. Sua atuação abrange todo o território nacional e, no exterior, opera por meio de escritório de representação nos Estados Unidos. Seu capital social pertence integralmente à União.	
2.2	Principais alterações no quadro societário nos últimos cinco anos.
N/A.	
2.3	Qual a estrutura empresarial do grupo?

CONGLOMERADO CAIXA – ESTRUTURA E COMPOSIÇÃO SOCIETÁRIA

OR005154

2.4	Forneça o Organograma da Empresa (anexar Resumo Profissional dos principais executivos conforme modelo constante na Seção 3)

ORGANOGRAMA



OR005154

2.5	Responsável perante a CVM (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3)

Alexandre Xavier Ywata de Carvalho – Vice-Presidente em exercício de Fundos de Investimento
Natural de Manaus/AM, cresceu em Salvador, Engenheiro Mecânico-Aeronáutico pelo Instituto Tecnológico de Aeronáutica (ITA), Mestre em Estatística pela Universidade de Brasília (UnB) e PhD em Estatística pela Northwestern University, em Chicago.

Foi Diretor Presidente na Caixa Participações, Diretor de Estudos e Políticas Regionais, Urbanas e Ambientais, Presidente Substituto e Chefe da Assessoria Técnica da Presidência no Instituto de Pesquisa Econômica Aplicada (Ipea), instituição da qual é funcionário de carreira. É professor de estatística e econometria no Instituto Brasiliense de Direito Público (IDP), e foi professor na Universidade de British Columbia, em Vancouver, na UnB, na Escola Nacional de Administração Pública (ENAP), e na Fundação Getúlio Vargas (FGV).
Possui Certificação ANBIMA CGA – Certificado de Gestor ANBIMA
Em 16 de abril de 2019, tomou posse como Vice-Presidente da Caixa Econômica Federal.

Daniel Boueres Sandoval - Diretor Executivo de Produtos e Administração de Fundos

Mestre em Economia pela FGV- EESP, com pesquisa na área de finanças comportamentais. Conclusão em 2016. MBA em Mercado de Capitais. FIPECAFI – USP. Conclusão em 2012. Pós-graduado em Administração de Empresas com ênfase em Mercado Financeiro e Banking. FGV – CEAG. Conclusão em 2010. Graduado em Relações Internacionais. PUC-SP. Conclusão em 2006.
Na CAIXA, desde 04/2019 até o presente momento é Diretor Executivo de Produtos e Administração de Fundos, atuando nos macroprocessos inteligência de mercado, estratégia de produto e gestão do portfólio, constituição e gerenciamento de produtos, canais e controladoria do passivo, e ainda, alinhamento estratégico com outras Vice-Presidências da CAIXA, além de estabelecer relacionamento estratégico com parceiros. No período de 11/2015 até 03/2019, foi Head of Sales, responsável pela estratégia de colocação do produto Fundos de Investimento na Caixa Econômica Federal, e pelo atendimento a investidores. A atividade inclui, dentre outras, a elaboração de estratégias de marketing, criação de produtos, adequação de portfólio, e o treinamento/capacitação da força de venda sobre as características dos produtos e estratégia de gestão das carteiras dos fundos de investimento. Anteriormente, entre 12/2009 até 10/2015, atuou como Officer, responsável pelo atendimento e assessoramento de clientes dos mais diversos perfis na alocação de seus recursos e montagem de suas carteiras de investimentos. O atendimento é feito à Pessoas Físicas em geral – varejo, varejo alta renda e private, Pessoas Jurídicas privadas – incluindo segmento corporativo, Investidores Institucionais e Regimes Próprios de Previdência Social.
Possui Certificação ANBIMA CGA – Certificado de Gestor ANBIMA, Certificação PLANEJAR CFP – Certified Financial Planner e Certificação ANBIMA CEA – Especialista em Investimento.

Jorge Louzada Kozlovsky - Diretor Executivo em exercício de Gestão Fundos de Investimento
Administrador de Carteira de Valores Mobiliários pela CVM; Certificação de Gestores ANBIMA (CGA); Pós-Graduado em Mercado Financeiro de Capitais (FIA), Bacharel em Administração de Empresas (Mackenzie).
Possui treze anos de experiência no Mercado Financeiro, sendo dez deles dedicados à mesa de operações e gestão de portfólios, com atuação nos times de Renda Fixa, Multimercados e Ações.
Condução da Gerência de Estratégia de Produtos e Estratégia de Distribuição de Fundos de Investimento. Atua também como Professor dos Cursos de Pós-Graduação e MBA da Saint Paul Escola de Negócios e Fundação Instituto de Administração (FIA) nas áreas de Fundos de Investimento, Renda Fixa e ALM (Asset Liability Management).

2.6	A empresa é signatária do Código de Regulação e Melhores Práticas da ANBIMA? Em caso afirmativo, citar o(s) Código(s).

Sim. A CAIXA é signatária dos seguintes Códigos da ANBIMA:

• Código ABVCAP/ANBIMA para o mercado de FIP e FIEE; • Código de Distribuição de Produtos de Investimento; • Código de Ética da ANBIMA; • Código de Negociação de Instrumentos Financeiros; • Código dos Processos da Regulação e Melhores Práticas; • Código para o Programa de Certificação Continuada; • Código para Serviços Qualificados ao Mercado de Capitais; • Código de Administração de Recursos de Terceiros; • Código para Ofertas Públicas..	
2.7	A empresa é signatária do Código de Ética da ANBIMA?
Sim.	
2.8	A empresa é signatária de outros Códigos ou assemelhados? Caso seja, citar as instituições.
Sim, em 05/2013, a CAIXA passou a ser signatária do PRI – Principles for Responsible Investment (Princípios para o Investimento Responsável).	
2.9	Os principais sócios ou os principais executivos detêm participação em outros negócios? Quais?
N/A.	
2.10	Os principais executivos exercem alguma atividade de representação ou governança (cargos em Conselhos, Diretorias, Comissões, Associações, Bolsas, etc.) em outras empresas ou entidades? Quais?
Sim. Representação CAIXA na ANBIMA: Forúm de Gestão de Fundos Estruturados Fórum de Distribuição Fórum de Estruturação do Mercado de Capitais Fórum de Negociação Fórum de Serviços Fiduciários Fórum de Gestão de Fundos Mútuos Comissão Temática de Administração e Custódia Comissão Operacional (Selic) Comissão de Renda Fixa Comissão de Varejo Comissão Temática de Imobiliário Comissão de Produtos de Tesouraria Comissão Temática de Participações Comissão de Autorregulação de Negociação Comissão de Institucionais Comissão de Autorregulação de Distribuição Grupo Consultivo de Cibersegurança Grupo Consultivo de Sustentabilidade Grupo Consultivo de Certificação e Educação Continuada Grupo Consultivo Permanente de Precificação Grupo Consultivo de Educação de Investidores GT Consulta Pública sobre Investimentos em RPPS GT Qualificação do Investidor GT Ranking de Mercado Externo GT Aperfeiçoamento das Regras Contábeis dos Fundos Conselho de Administração de Recursos de Terceiros Alguns executivos também participam de Conselhos em companhias investidas pelos fundos.	
2.11	Descreva breve histórico da empresa.
No dia 12 de janeiro de 1861, Dom Pedro II assinou o Decreto nº 2.723, que fundou a Caixa Econômica da Corte. Desde então, a Caixa caminha lado a lado com a trajetória do país,	

acompanhando seu crescimento e o de sua população. A Caixa sempre esteve presente em todas as principais transformações da história do país, como mudanças de regimes políticos, processos de urbanização e industrialização, apoiando e ajudando o Brasil.

Com sua experiência acumulada, inaugurou, em 1931, operações de empréstimo por consignação para pessoas físicas; três anos depois, por determinação do governo federal, assumiu a exclusividade dos empréstimos sob penhor, o que extinguiu as casas de prego operadas por particulares.

No dia 1º de junho do mesmo ano, foi assinada a primeira hipoteca para a aquisição de imóveis da Caixa do Rio de Janeiro.

Em 1986, a Caixa incorporou o Banco Nacional de Habitação (BNH) e assumiu definitivamente a condição de maior agente nacional de financiamento da casa própria e de importante financiadora do desenvolvimento urbano, especialmente do saneamento básico. No mesmo ano, com a extinção do BNH, tornou-se o principal agente do Sistema Brasileiro de Poupança e Empréstimo (SBPE), administradora do FGTS e de outros fundos do Sistema Financeiro de Habitação (SFH).

Quatro anos depois, em 1990, iniciou ações para centralizar todas as contas vinculadas do FGTS, que, à época, eram administradas por mais de 70 instituições bancárias.

Ao longo de sua trajetória, a Caixa vem estabelecendo estreitas relações com a população ao atender às suas necessidades imediatas, como poupança, empréstimos, FGTS, Programa de Integração Social (PIS), Seguro-Desemprego, crédito educativo, financiamento habitacional e transferência de benefícios sociais.

Também deu ao povo brasileiro a chance de sonhar com uma vida melhor, com as Loterias Federais, das quais detém o monopólio desde 1961.

O ano de 1969 foi um dos marcos na história da Caixa. O Decreto-Lei Nº 759 daquele ano a constituiu como uma empresa pública e deu a ela diversas obrigações e deveres, com foco em serviços de natureza social, promoção da cidadania e do desenvolvimento do país.

Desde sua criação, a Caixa não parou de crescer, de se desenvolver, de diversificar e ampliar suas áreas de atuação. Uma prova é seu estatuto, renovado sempre que é preciso se adaptar à realidade dos brasileiros. A última atualização foi 2013 por meio do Decreto Nº 7.973. A Caixa, além de atender a correntistas, trabalhadores, beneficiários de programas sociais e apostadores, acredita e apoia iniciativas artístico-culturais, educacionais e desportivas em todo o Brasil.

Hoje, a Caixa tem uma posição consolidada no mercado como um banco de grande porte, sólido e moderno. Como principal agente das políticas públicas do governo federal, está presente em todo o país, sem perder sua principal finalidade: a de acreditar nas pessoas.

2.12	A Empresa possui Código de Ética e Conduta, Manual de Compliance, Manual de Risco, Manual de marcação a mercado, Manual de Gestão de Liquidez, Política de *Suitability*. Em caso afirmativo, favor anexar.
Sim.	
2.13	Cite os Comitês formais, a sua composição em termos de cargos, a frequência com que são realizadas as suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões.
Seguem as principais atribuições dos Comitês da Vice-Presidência Fundos de Investimento e do Conselho de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA.	

Conselho de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros:

O Conselho de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros é o órgão colegiado estatutário deliberativo, responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários na CAIXA.
Composição: Presidente da CAIXA; Vice-Presidente de Fundos de Investimento; Vice-Presidente de Riscos; Vice-Presidente de Distribuição; e, sem direito a voto, o Diretor Jurídico.
Periodicidade: Bimestral

Comitê de Planejamento e Gestão:

O Comitê de Planejamento e Gestão é responsável pela definição das políticas e estratégias de atuação da Vice-Presidência, pela organização e posicionamento do portfólio de produtos de fundos investimento, pelo monitoramento das métricas de gestão de riscos e controles e pela implementação das ações que consolidam a plena segregação da administração de ativos de terceiros, observadas as diretrizes do Conselho de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros.
Composição: Vice-Presidente de Fundos de Investimento; Diretor Executivo de Gestão de Fundos de Investimento; Diretor Executivo de Produtos e Administração de Fundos; Superintendente Nacional de Fundos de Investimentos Especiais; Superintendente Nacional de Gestão de Fundos Líquidos; Gerente Nacional de Investidores Corporativos; Gerente Nacional de Risco de Ativos de Terceiros; e 02 Consultores de Dirigente. *Periodicidade:* Mensal

Comitê de Investimento:

O Comitê de Investimento avalia opções de investimento e estabelece estratégias de alocação dos recursos de Fundos Líquidos com base nos cenários, perspectivas de mercado e potenciais riscos e delibera sobre o exercício de direito de voto nas assembleias de ativos detidos pelos fundos de investimento geridos pela Superintendente Nacional de Gestão de Fundos Líquidos.
Composição: Diretor Executivo de Gestão de Fundos de Investimento; Superintendente Nacional de Gestão de Fundos Líquidos; 1 Gerente Nacional e 2 Gerentes Executivos de Fundos de Renda Fixa; 1 Gerente Nacional e 2 Gerentes Executivos de Fundos de Renda Variável. *Periodicidade:* Mensal

Comitê de Investimento para Fundos de Fundos:

O Comitê de Investimento para Fundos de Fundos (FoF) elabora as estratégias de alocação de ativos pelos Fundos Multigestores em fundos geridos por outras instituições ou em outros ativos, monitorando e avaliando o desempenho e os potenciais riscos dos ativos selecionados, e delibera sobre o exercício de direito de voto nas assembleias de ativos detidos pelos fundos multigestores.
Composição: Diretor Executivo de Gestão de Fundos de Investimento; Superintendente Nacional de Fundos de Investimentos Especiais; 1 Gerente Nacional e 1 Gerente Executivo de Desenvolvimento de Fundos Estruturados; Gerente Nacional de Produto, Inovação, Inteligência de Mercado e Projetos de Tecnologia; Gerente Nacional de Investidores Corporativos. *Periodicidade:* Trimestral.

Comitê de Administração Fiduciária:

	O Comitê de Administração Fiduciária delibera sobre atos relevantes da administração de carteiras de valores mobiliários na categoria de administrador fiduciário e aprova políticas e diretrizes para atuação do administrador fiduciário. *Composição:* Diretor Executivo de Produtos e Administração de Fundos; Gerente Nacional de Administração Fiduciária; Gerente Nacional de Produto, Inovação, Inteligência de Mercado e Projetos de Tecnologia; Gerente Nacional de Investidores Corporativos; Gerente Executivo de Risco de Ativos de Terceiros. *Periodicidade:* Bimestral **Comitê de Gestão de Fundos Especiais:** O Comitê de Gestão de Fundos Especiais aprova políticas e estratégias de alocação de ativos dos fundos estruturados a partir da análise da conjuntura, cenários, perspectivas do mercado ligado a fundos estruturados e potenciais riscos e delibera sobre o exercício de direito de voto nas assembleias de ativos que compõem as carteiras dos fundos especiais sob gestão. *Composição:* Vice-Presidente de Fundos de Investimento; Diretor Executivo de Gestão de Fundos de Investimento; Superintendente Nacional de Fundos de Investimentos Especiais; Gerente Nacional de Gestão de Fundos Estruturados; Gerente Nacional de Desenvolvimento de Fundos Estruturados. *Periodicidade:* Mensal **Comitê de Gestão de Recursos do FGTS por meio de Fundos Especiais:** O Comitê de Gestão de Recursos do FGTS por meio de Fundos Especiais elabora as estratégias de alocação de ativos pelo FI-FGTS e Carteiras Administradas Estruturadas do FGTS. Também delibera sobre propostas de alteração na política de investimento e acompanha a evolução dos investimentos realizados pelo FGTS por meio de Fundos Especiais. Também delibera sobre o exercício de direito de voto nas assembleias de ativos detidos pelo FI-FGTS e Carteiras Administradas Estruturadas do FGTS. *Composição:* Vice-Presidente de Fundos de Investimento; Diretor Executivo de Gestão de Fundos de Investimento; Diretor Executivo de Produtos e Administração de Fundos; Superintendente Nacional de Fundos de Investimentos Especiais; Gerente Nacional de Gestão de Fundos Estruturados; Gerente Nacional de Desenvolvimento de Fundos Estruturados; Gerente Nacional de Risco de Ativos de Terceiros; 02 Consultores de Dirigente. *Periodicidade:* Mensal **Comitê de Riscos:** O Comitê de Riscos é responsável por analisar, acompanhar, avaliar e deliberar sobre os princípios e diretrizes da Política de Riscos da Vice-Presidência Fundos de Investimento, os critérios, procedimentos e limites para avaliação e controle dos riscos de mercado, crédito e liquidez, os procedimentos a serem adotados em casos de alerta e quaisquer outros assuntos relativos à gestão de riscos de mercado, crédito e liquidez não expressamente previstos. *Composição:* Gerente Nacional de Risco de Ativos de Terceiros; Gerente Nacional de Investidores Corporativos; Gerente Executivo de Risco de Ativos de Terceiros; Gerente Nacional de Administração Fiduciária; Gerente Nacional de Fundos de Renda Fixa; Gerente Nacional de Fundos de Renda Variável. *Periodicidade:* Bimestral
2.14	Se o grupo econômico da empresa presta serviços de administração, controladoria e custódia descreva a estrutura e o relacionamento com a empresa de gestão (anexar Resumo

	Profissional conforme modelo constante na Seção 3)

Os serviços de administração e gestão dos recursos de terceiros são prestados pela própria VIART – Vice Presidência Fundos de Investimento.

Dentro da VIART as atividades de administração são efetuadas pela DEPOT – DE Produtos e Administração de Fundos.
As atividades de gestão são realizadas pela SUGET – Superintendência Nacional de Gestão de Ativos de Terceiros e, no caso de fundos especiais, pela SUFES – Superintendência Nacional Gestão Fundos Especiais.

Já os serviços de custódia e controladoria são prestados através de outra vice-presidência, a VILOP - Vice Presidência Logística e Operações por intermédio da SUBAN – Superintendência Nacional Operações Bancárias:

ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO:

DEPOT – DIRETORIA EXECUTIVA PRODUTOS E ADMINISTRAÇÃO DE FUNDOS

- Administração Fiduciária de ativos de Terceiros.
- Produtos para ativos de Terceiros.

SUFES – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL GESTÃO FUNDOS ESPECIAIS

- Desenvolvimento e gestão de carteiras e de fundos de investimentos especiais e estruturados.

SUGET – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL GESTÃO FUNDOS LÍQUIDOS

- Estratégias para composição de fundos de investimentos e carteiras administradas.
- Gestão de ativos de terceiros.
- Middle Office de fundos de investimento.

CUSTÓDIA E CONTROLADORIA:

SUBAN – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL PROCESSOS BANCÁRIOS

- Soluções para processos bancários adequadas às necessidades da CAIXA.

GESEN – GERÊNCIA NACIONAL SERVIÇOS QUALIFICADOS E NUMERÁRIO

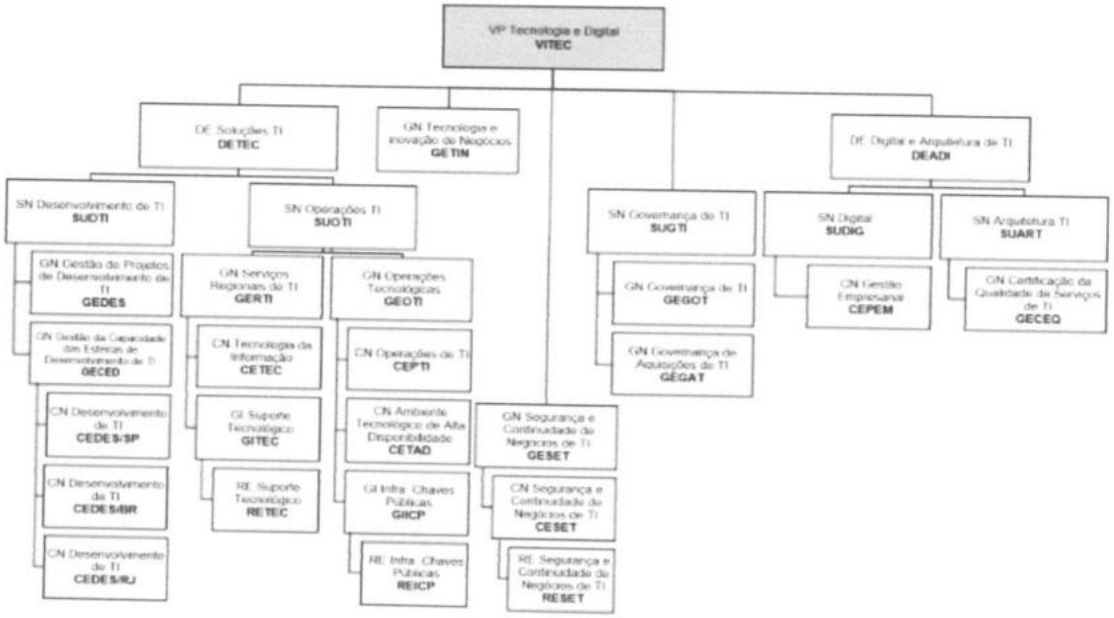
- Metodologia para marcação a mercado de ativos de terceiros e precificação de ativos de terceiros.
- Controladoria de Passivos.
- Escrituração de valores mobiliários.
- Serviços Qualificados para o Mercado de Capitais.
- Estratégias de gestão de numerário na CAIXA.
- Estratégias para prospecção e relacionamento com novos clientes para os serviços de Custódia Qualificada.
- Estratégias e monitoramento dos serviços qualificados para o mercado de capitais.
- Estratégia e controle do backoffice das operações de câmbio e comércio exterior.
-Custódia de numerário apreendido.
- Back office das operações de Banco de investimento.

CELIT – CENTRALIZADORA NACIONAL LIQUIDAÇÃO DE TÍTULOS E TESOURARIA

- Administração das Operações de Câmbio Financeiro.
- Liquidação física e financeira dos ativos financeiros, valores mobiliários, derivativos e direitos creditórios ("ativos"), sua guarda e conciliação, bem como a administração e informação de eventos associados a esses ativos (Custódia Qualificada).
- Operacionalização de procedimentos de controladoria de Ativos de fundos de investimento e carteiras administradas.
- Execução da custódia, registro e liquidação das operações da mesa de Tesouraria CAIXA (Carteira Própria, Home Broker e Tesouro Direto) e Terceiros (Fundo de Investimento e Carteira Administrada), nas Câmaras do SPB.
- Operacionalização de procedimentos de controladoria de Passivos.
- Conciliação das contas no exterior, Registro e Liquidação das Operações de Câmbio Financeiro.
- Análise e controle das operações de câmbio financeiro.
- Qualificação, registro e informações aos órgãos reguladores das operações de câmbio.
- Backoffice de operações de comércio exterior

2.15	A instituição possui área de tecnologia da informação própria? Caso afirmativo, detalhar as atividades atuais, organograma e a qualificação dos profissionais.

Sim, através da **VITEC – Vice Presidência Tecnologia e Digital**.



OR005154

A VITEC, com cerca de 30 unidades como diretorias, superintendências, gerências, centralizadoras e representações, atua com a construção, manutenção e disponibilização de soluções de tecnologia da informação e comunicação para sustentar as atividades de negócio e funcionais da CAIXA.

3 - Números da Empresa

3.1 – Preencha a Tabela abaixo com os valores correspondentes aos números da Empresa.

	Ano	Patrimônio sob gestão (posição de final de período)	Número de pessoas que trabalham na empresa	Número de portfólios gestão	

2016	422.415.267.888,75	185	312
2017	427.545.960.661,15	188	318
2018	498.372.066.134,41	224	318
2019	523.305.557.330,35		317
2020	528.729.110.275,00		317

3.2 Tipologia dos portfólios sob gestão (* sem dupla contagem)

	Nº	% Carteira
Fundos:		
Domicílio local	298	76,33%
Domicílio em outro país		
Clubes		
Carteiras		
Domicílio local	19	23,67%
Res. Nº 2.689		
TOTAL	**317**	**100%**

3.3 Como os ativos sob gestão estão divididos conforme as seguintes categorias de fundos de investimento?

Tipo	Nº	Exclusivos	% total
Curto Prazo			
Referenciado			
Cambial	2	1	0,04%
Renda Fixa	192	88	59,29%
Multimercado	54	16	8,19%
Dívida Externa			
Ações	32	1	3,09%
FIDC	4	3	0,40%
FIP	5	5	4,93%
FIEE			
FII	8	6	0,40%
Fundo de Índice (ETF)	1	0	0,00%
Outras categorias	19	19	23,67%

3.4 Com quantos distribuidores e/ou alocadores a Empresa tem acordos ou contratos de distribuição?

A CAIXA conta com apenas um fundo distribuído por um distribuidor externo.

3.5 Considerando o volume total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores distribuidores ou alocadores?

N/A.

3.6 Atualmente, qual é o percentual do volume sob gestão que são originados especificamente de aplicações da própria Empresa (incluindo controladores, coligadas, subsidiárias, seus sócios e principais executivos)?

N/A.

3.7 Qual a distribuição do passivo segundo tipologia de investidor?

Tipo	Cotistas	% Passivo
Pessoas Físicas	1.272,801	11,56%
Empresas	354.310	14,04%

Instituições Financeiras/ Seguradoras/ Soc. de Capitalização	53	0,54%
Investidores Institucionais Previdenciários	66	16,72%
Distribuidores, Alocadores (inclui fundos de fundos de terceiros e family offices)	286	0,15%
Investidor Estrangeiro	7	0,19%
Governo	16.636	56,79%

3.8	Considerando o volume total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos 10 maiores clientes? Fornecer o percentual detido por cada um deles.

10 Maiores Cotistas	%
1	28,03%
2	14,91%
3	2,91%
4	1,40%
5	1,16%
6	0,66%
7	0,50%
8	0,40%
9	0,37%
10	0,32%
Total	**50,66%**

4 - Receitas da Empresa

4.1	Qual a estrutura de receitas da Empresa? (gestão, performance, comissões, rebates etc.)

Gestão, distribuição, administração, estruturação e performance.

4.2	Qual parcela do resultado da Empresa vem da atividade de gestão de carteiras?

11,85% referente à RPS Ano Fiscal 2019.

4.3	A receita de Taxa de Administração é suficiente para cobrir os custos da Empresa?

Sim.

5 - Recursos Humanos

5.1	Quais as regras de remuneração ou comissionamento dos funcionários e associados?

A estrutura de remuneração fixa na CAIXA é baseada na designação de Função de Confiança ou Cargo Comissionado, de forma que o funcionário no exercício do cargo faz jus ao recebimento de comissão efetiva. Caso o desempenho não seja satisfatório poderá ocorrer à dispensa da Função de Confiança ou do Cargo Comissionado retroagindo ao salário padrão.
Os funcionários recebem além da remuneração fixa, participação nos lucros e premiação em clubes de compras

5.2	Quais são os mecanismos de retenção de talentos usados pela Empresa?

O atual modelo de gestão de pessoas tem como objetivo consolidar uma cultura organizacional baseada na gestão proativa de talentos e por competência. A ideia é dar ênfase à meritocracia, à inovação, à alta eficiência e à melhoria contínua, promovendo identificação dos empregados com os valores e a missão da CAIXA, engajamento das lideranças e excelência no relacionamento com clientes e sociedade.
Além dos diversos programas voltados à saúde e à segurança dos empregados, a Instituição busca integrar a educação corporativa à gestão do desempenho e das competências e à gestão do conhecimento, por meio de incentivos à capacitação, de criação e manutenção de sistemas e processos de disseminação do conhecimento e desenvolvimento de habilidades.
Outro benefício que a Instituição oferece aos empregados é a possibilidade de complementar sua renda, após a aposentadoria, por meio de patrocínio a planos de benefício de previdência

complementar, administrados pela Fundação dos Economiários Federais – FUNCEF. Por ser empresa pública a CAIXA oferece estabilidade de emprego aos funcionários e um plano de carreira para cada função de interesse, com funções intermediárias que satisfaçam os funcionários em múltiplos níveis. Para algumas funções é oferecida a jornada de trabalho de 30 horas semanais de forma a respeitar e permitir o equilíbrio entre vida e trabalho. Atuando em todo território nacional e em diferenciados segmentos a CAIXA disponibiliza facilidades de transferência de funcionários entre departamentos e regiões.	
5.3	Existe uma política para treinamento e desenvolvimento profissional dos funcionários/associados? Qual?
Sim. No processo de formação de carreiras, a empresa oferece Universidade Corporativa com diversos cursos de aperfeiçoamento pessoal e corporativo, exige certificação qualificada, e disponibiliza verbas anuais para cursos de atualização e aperfeiçoamento (Graduação, Pós-Graduação, Mestrado e Cursos de Idiomas). Vinculada à dimensão "Aprendizado e Crescimento" do Plano Estratégico Caixa 2018 – 2022, foi criada a Escola de Negócios VIART, que tem como proposta desenvolver ações alinhadas com o Plano Estratégico Caixa e com o Mapa Estratégico VIART.	
6 - Informações Gerais	
6.1	Qual o limite para o crescimento dos ativos sob gestão suportado pela atual estrutura da Empresa (instalações, equipe, *hardware* e *software*)? Existem planos de expansão?
A CAIXA mantém um planejamento de expansão até 2022, sendo que há um acompanhamento anual para identificar como está a estratégia.	
6.2	A empresa já foi objeto de avaliação por agência de *rating*? Qual a nota atribuída à gestão? (anexar relatório mais recente)
Sim. Fitch Ratings - São Paulo, 04 de setembro de 2019: A Fitch Ratings reafirmou o Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos 'Forte' da VIART, unidade de negócios da Caixa Econômica Federal (CAIXA).	
6.3	A empresa já recebeu alguma premiação por publicações ou entidades no que tange à qualidade e ao histórico de gestão? Quais?
Guia Exame 2010 - Melhor gestor de fundos de varejo e melhor gestor de fundos de renda fixa ativa. Guia Exame 2011 - 2º melhor gestor de fundos de varejo e 3º melhor gestor de fundos de renda fixa ativa. Star Ranking Valor Econômico 2013 – 22 fundos premiados, sendo o principal critério de avaliação a relação risco x retorno. Revista Investidor Institucional - Os Melhores Fundos para Institucionais – Nov./2013– A CAIXA conquistou o topo do ranking com o maior número de fundos excelentes. Star Ranking Valor Econômico 2014 – 22 fundos premiados, sendo o principal critério de avaliação a relação risco x retorno. Revista Investidor Institucional – Top Asset – Mar./2014 – Presente no Ranking Top Asset em 18 categorias do ranking Exame - Onde Investir em 2015 - Os Melhores Gestores – Nov./2014 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Revista Investidor Institucional – Top Asset – Mar./2015 – Presente no Ranking Top Asset em 20 categorias Fundo FI CAIXA Brasil IDKA IPCA 2A RF LP destinado aos RPPS foi eleito pelo jornal Valor Econômico em matéria de 21/01/2015 como o melhor fundo de renda fixa em 2015. Exame - Onde Investir em 2016 - Os Melhores Gestores – Dez./2015 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Revista Investidor Institucional - Os Melhores Fundos para Institucionais – Abr./2016– A CAIXA conquistou o topo do ranking com oito fundos classificados como excelentes. Premiada pelo Guia EXAME –Investimentos Pessoais – por 13 anos consecutivos (2004 – 2016) também, foi eleita uma das maiores gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset – AGO 17, realizado pela revista Investidor Institucional. Conquistou a posição de maior	

gestora em duas categorias:
• Maior Gestor de FIPs;
• Maior Gestor de RPPS;
Prêmio MBI Melhor Banco para Investir – Melhor Gestor de Renda Fixa e Melhor Gestor de Ações – Fev./2018
Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas - 2º Melhor Gestor Geral e Melhor Gestor em Fundos Balanceados até 15 - edição 2018 do Guia de Previdência Valor/FGV;
Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Março/2018) - 5 Fundos Classificados como excelentes;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Agosto/2018) - 4 Fundos Classificados como excelentes;

Ranking Exame – Onde Investir 2019 - 2º Melhor Gestor de Varejo;

Prêmio MBI/FGV – Melhor Banco para Investir - 2ª melhor gestor em Fundos Money Market e 2ª melhor gestor de fundos multimercados FEV/19;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 312 – Março/2019) –9 Fundos classificados como excelentes;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 317 –Agosto/2019) – CAIXA no 2º lugar no Ranking de Gestores com 22 Fundos classificados como excelentes;

Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas – CAIXA como Gestora Destaque em Fundos Balanceados até 15 - Edição 2019

Ranking Exame – Onde Investir 2020 – 3º Melhor Gestor de Renda Fixa, 3º Melhor Gestor de Fundos DI e Curto Prazo e 3º Melhor Gestor de Fundos de Varejo;

Prêmio MBI/FGV – Melhor Banco para Investir - 1ª melhor gestor de fundos multimercados, 1ª melhor gestor de fundos de ações, 2ª melhor gestor em Fundos Money Market e 2ª melhor gestor em Fundos de Renda Fixa FEV/20;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 323 – Março/2020) – 10 Fundos classificados como excelentes.

7 - Informações Operacionais

7.1 - Análise Econômica e Pesquisa

7.1.1	Descreva a estrutura de análise econômica e de pesquisa da empresa (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3)

A unidade de pesquisa econômica e setorial possui três mandatos distintos, quais sejam, o de Pesquisa Econômica, responsável pela definição do cenário macro doméstico e internacional, bem como pela projeção de indicadores, a de Pesquisa Setorial, responsável pela definição do cenário setorial e pela avaliação econômico-financeira de empresas, e, por fim, a de Pesquisa Quantitativa, responsável pela análise de ativos e estratégias de alocação com o uso de modelos computacionais.

A equipe é composta por treze profissionais, sendo um Consultor, um Gerente Executivo, um Gerente de Negócios e um Coordenador. A equipe técnica é formada por cinco colaboradores de análise econômica e quatro técnicos responsáveis pela análise setorial.

7.1.2	Principais mudanças na equipe de pesquisa nos últimos cinco anos

A equipe de pesquisa foi formada em julho/2008. Em 2019, a equipe de pesquisa passou por uma reformulação abrangente, recebendo quatro novas posições (com a equipe passando de 8 para 12

pessoas). Em 2020, ao quadro original foi acrescido uma nova função estratégica/gerencial.	
7.1.3	Utiliza *research* próprio ou de terceiros? Em que proporções?
No que se refere à análise econômica, cerca de 90% do material é produzido internamente. Nesse percentual está incluso a cobertura da Economia Brasileira, Americana e Zona do Euro e China. Os 10% restantes referem-se a research de terceiros relacionados à economia internacional. Do ponto de vista da análise setorial, cerca de 40% do material são produzidos internamente. O universo atual de cobertura é de 50 empresas, com previsão de aumento para os próximos 12 meses. O complemento toma como base material externo.	
7.1.4	Caso utilize *research* próprio, quais ferramentas de análise são utilizadas no processo decisório? Esta equipe trabalha exclusivamente para o *buy side* ou também produz relatórios e informações para outros (*sell side*)?
A equipe de pesquisa é estritamente voltada para o *buy side*. O time de pesquisa econômica e setorial atua diretamente no processo de investimento, que é um ciclo composto de quatro etapas. Nas duas primeiras, são discutidos grandes temas ligados à economia local e doméstica. No terceiro é discutido o impacto destes temas nas classes de ativos e, finalmente, na quarta etapa, são apresentadas as proposições de alocação por partes dos gestores de fundos. No que se refere à pesquisa econômica, o processo de construção do cenário envolve a deliberação das hipóteses base e premissas junto ao time, que analisa séries históricas, estudos realizados, modelos econômicos e projeções destes derivados para a formulação de seu ponto de vista. Em relação à pesquisa setorial, utiliza-se como base o *valuation* das empresas para as quais temos cobertura, acompanhamento de notícias, o contato direto com o RI das empresas e a análise de mercado.	
7.1.5	Que serviços ou sistemas são contratados para apoio na análise?
São contratadas consultorias setoriais e econômicas, além de serviços de informação online, bancos de dados de indicadores econômico-financeiros, software econométrico e ferramentas de análise técnica.	
7.2 – Gestão de Recursos	
7.2.1	Descreva a estrutura de gestão de recursos da empresa (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3)
A VIART possui uma Superintendência (SUGET) onde é realizada a Gestão de Fundos de Investimentos no âmbito da Instrução CVM nº 555, e está dividida em 02 Gerências Nacionais dedicadas à Gestão de Fundos de Renda Fixa (GEFIX) e de Renda Variável (GEVAR). Em relação aos Fundos Estruturados, a SUFES possui a Gerência GEAFE. (Conforme organograma do item 2.4).	
7.2.2	Principais mudanças na equipe de gestão nos últimos cinco anos.
As principais mudanças na equipe de gestão da SUGET foram: Foi designado como Superintendente da SUGET o Sr. Vitor Hugo Falcao Marcondes Sodre; Foi designado como Gerente Nacional da GEVAR, o Sr. Melchior Vinicius dos Santos Felix; Foi designado como Gerente Nacional da GEFIX, o Sr. Carlos Eduardo Biteli	
7.2.3	Que serviços ou sistemas são contratados para apoio na gestão?
• Bloomberg (provedor de informações); • Broadcast (provedor de informações); • Economática (Banco de Dados/Ferramenta de análise pair trading); • Quantum (informações/serviços de análises econômicos financeiras relacionadas a fundos de investimento e empresas).)	
7.2.4	Qual o processo de seleção e acompanhamento das corretoras?
Operações em Mercados de Bolsa	

O processo de seleção é dividido em dois grupos: para corretoras que atuam nos Mercados BOVESPA e para corretoras que atuam nos Mercados BM&F. A cada semestre civil são selecionadas doze instituições para realizar operações nos Mercados BOVESPA e doze instituições realizar operações nos Mercados BM&F. As etapas do processo de seleção são as mesmas para ambos os grupos e destinadas respectivamente à verificação das informações cadastrais, análise de Gerenciamento de Risco, preenchimento do QDD ANBIMA Serviços Qualificados e Corretoras, análise qualitativa do departamento técnico e de pesquisa das corretoras/distribuidoras e avaliação interna da qualidade operacional dos serviços prestados no quadrimestre analisado.

Observação: para participar da seleção para operações nos Mercados BM&F, é obrigatório que as corretoras/distribuidoras possuam o selo *Execution Broker B3* e ser associado ANBIMA ou ter aderido ao Código de Melhores Práticas e ao Código de Negociação de instrumentos Financeiros.

Operações em Mercado de Balcão

Estão habilitadas a realizar operações via Mercado de Balcão exclusivamente Instituições Intermediadoras que sejam membros da ANBIMA e corretoras/distribuidoras que possuam o selo *Execution Broker* e ser associado ANBIMA ou ter aderido ao Código de Melhores Práticas e ao Código de Negociação de instrumentos Financeiros e com adesão ao nosso contrato de Intermediação.

7.2.5	Liste as corretoras aprovadas.

SELECIONADAS PARA MERCADOS BMF - OPERAÇÕES 2ºSEM 2020
Bradesco
BTG Pactual
Santander
UBS Brasil
Credit Suisse
XP Investimentos
BGC Liquidez
Tullett Prebon Brasil
Guide Investimentos
CM Capital Markets
Renascença
Necton Investimentos
SELECIONADAS MERCADO BOVESPA - OPERAÇÕES 2ºSEM2020
Ativa
Bradesco
BTG Pactual
BGC Liquidez
Credit Suisse
CM Capital Markets
Guide
Itau
Santander
Tullett
Renascença
J.P Morgan

7.2.6	Que critérios orientam a divisão de ordens entre as corretoras selecionadas? Comente concentração, rodízio e o uso de *discount brokers* e *research brokers*.
Nos mercados de Bovespa e BM&F, os volumes são divididos conforme classificação de nota da avaliação. Na divisão dos percentuais, sendo as 6 primeiras *Research* e as próximas 6 *Discount*: • 10% do Limite para as cada uma 4 primeiras – 40% total; • 8,25% do Limite para as próximas 4 – 33% total; • 6,75% do limite para as outras 4 – 27% total; O processo de seleção é semestral e a cada avaliação e são substituídas 2 corretoras *Research* e 2 corretoras *Discount*. No mercado de balcão, existe um limite máximo de 25% do total da corretagem paga no semestre.	
7.2.7	Qual é a política de gestão de caixa da empresa? Há uso de operações compromissadas com títulos públicos, outros fundos de investimento, CDBs de um dia? Descreva-a.
A política de gestão de caixa privilegia o uso de operações compromissadas de um dia lastreadas em títulos públicos federais.	
7.2.8	Como a gestão controla o prazo médio dos títulos para fundos de longo prazo, para fins de sua classificação tributária?
O prazo médio para fins de enquadramento e classificação tributária é controlado diariamente em sistema proprietário ou através de sites de bancos custodiantes. As operações para fins de ajuste de prazo médio são feitas sempre que necessário.	
7.2.9	De que forma o desempenho dos gestores e dos fundos é avaliado?
Os gestores são avaliados essencialmente sob dois aspectos: (i) Desempenho absoluto dos fundos sob sua gestão – refere-se à comparação com seus respectivos *benchmarks* e rentabilidades alvo. (ii) Desempenho relativo dos fundos sob sua gestão – refere-se à comparação com amostras de fundos concorrentes. Adicionalmente, devido à segmentação da gestão por células especialistas em cada mercado, individualmente os gestores possuem ainda objetivos financeiros para geração de alfa em seus mercados de atuação.	
7.2.10	A quem os gestores prestam conta da performance dos fundos?
Mensalmente é realizada reunião para acompanhamento dos resultados dos fundos junto ao Diretor Executivo responsável pela Gestão de Recursos de Terceiros.	
7.3 – Risco	
7.3.1 – Estrutura	
7.3.1.1	Descreva a estrutura de gerenciamento de riscos da empresa (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3)
A Gerência Nacional de Risco de Ativos de Terceiros está vinculada diretamente à Vice Presidência Fundos de Investimento e conta com 01 Gerente Nacional, 1 Gerente Executivo, 3 Gerentes de Clientes e Negócios III e 10 Técnicos para realizar o Gerenciamento e Monitoramento dos Riscos de Mercado, Crédito e Liquidez dos Fundos de Investimentos e Carteiras Administradas sob Administração/Gestão da VIART.	
7.3.1.2	Quem é o responsável pela área e a quem se reporta?
O responsável pela Gerência Nacional de Risco de Ativos de Terceiros é o Gerente Nacional, Sr. Daniel José Ferraz dos Santos. O referido profissional reporta-se diretamente ao Vice-Presidente e.	
7.3.1.3	Principais mudanças na equipe de risco nos últimos cinco anos.
Houve mudança do Gerente Nacional responsável pela área de risco	
7.3.1.4	Que serviços/sistemas são utilizados para apoio no controle de risco? São desenvolvidos internamente ou contratados junto a terceiros? Quem os fornece? Como foram escolhidos? Citar, especificamente, por tipo de risco (crédito, contraparte, preço, liquidez e operacional).

O sistema utilizado para o gerenciamento do Risco de Mercado é o MAPS Solutions. Com relação ao gerenciamento dos riscos de liquidez e crédito, o monitoramento é realizado por aplicativo desenvolvido internamente com base em banco de dados SQL.	
7.3.1.5	Quais são os relatórios de riscos, com que freqüência são gerados, o que contêm e quem recebe e analisa estes relatórios?
Diariamente são elaborados relatórios de Risco de Mercado, Crédito e Liquidez com informações de nível de exposição aos riscos, comprometimento de limites de exposição que são enviados aos gestores, ao Vice-Presidente e à Área de Conformidade da Vice-Presidência.	
7.3.2 - Risco de Crédito	
7.3.2.1	Descreva a metodologia de gestão do risco de crédito das carteiras.
A alocação em ativos privados segue as diretrizes e os limites de exposição estabelecidos em normativo interno, com base em notas de Rating atribuídas pela área de risco de crédito da CAIXA.	
7.3.2.2	Como cada nova operação de crédito é analisada e aprovada?
A área de risco de crédito da CAIXA realiza a análise de risco de crédito sob demanda e atribui nota de risco à operação ou emissor, o gestor verifica o enquadramento da operação nos limites estabelecidos. Casos não previstos na Política de Riscos da VIART são levados ao Comitê de Riscos e/ou Comitê de Planejamento e Gestão.	
7.3.2.3	A empresa, independentemente do critério de precificação, possui algum procedimento ou estratégia no caso da iminência ou ocorrência de eventos de inadimplência?
A área de Risco da VIART possui autonomia para suspender limites de alocação em ativos privados quando identificado aumento potencial do seu risco de crédito.	
7.3.3 - Risco de Contraparte	
7.3.3.1	Descreva a metodologia de gerenciamento do risco de contraparte.
São estabelecidos limites de concentração por emissor e no caso de operações de derivativos sem garantia é verificado o enquadramento da contraparte nos limites de exposição.	
7.3.3.2	Como são selecionadas as contrapartes e aprovados seus limites?
Os limites de exposição são aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros.	
7.3.4 - Risco de Preço	
7.3.4.1	Descreva a(s) metodologia(s) adotada(s) para a apuração do risco de preço (ex: VaR, *Stress Test*, *Stop loss*, etc).
A mensuração do Risco de Mercado é realizada através do Modelo de Risco VaR Paramétrico com nível de confiança de 95% em um horizonte de tempo de 1 dia.	
7.3.4.2	Como são formalizados os controles de risco de preço?
Os critérios de mensuração e os limites de exposição são propostos pela área de gerenciamento de riscos da VIART ao Comitê de Planejamento e Gestão da Vice-Presidência e ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros para aprovação.	
7.3.4.3	Como é realizado o controle e o monitoramento de limites das estratégias (ex.: *books* tais como volatilidades, direcionais, arbitragens etc)? Com que frequência de atualização?
O controle e monitoramento de limites das estratégias são realizados pela GERAT - Gerencia de Risco de Ativos de Terceiros.	
7.3.4.4	Nos casos de posições que ultrapassem seus limites, como é o processo de tomada de decisão para o reenquadramento?
A violação dos limites é reportada ao Comitê de Planejamento e Gestão, com detalhamento dos motivos que levaram à extrapolação para avaliação e tomada de decisão.	
7.3.4.5	O administrador ou o custodiante realiza controles de risco adicional para as carteiras do gestor? Em caso afirmativo, fornecer detalhes.
N/A.	
7.3.5 - Risco de Liquidez	
7.3.5.1	Descreva a(s) metodologia(s) adotada(s) para a apuração do risco de liquidez, incluindo o tratamento de baixa liquidez e/ ou resgates excessivos.
As regras para administração do risco de liquidez, envolvendo práticas, processos, procedimentos,	

modelos e reportes foram estabelecidas pelo Comitê de Risco visando manter a exposição a este risco em níveis aceitáveis e evitar que ocorram desequilíbrios entre os ativos negociáveis e os passivos exigíveis que possam afetar a capacidade de pagamento da CAIXA. O gerenciamento deste risco é realizado por meio de modelos internos de projeção dos fluxos financeiros dos produtos, serviços e operações, em situação de normalidade e de estresse. Para enfrentar situações de estresse, foi estabelecido Plano de Contingência de Liquidez com o objetivo de identificar antecipadamente e aumentar a capacidade da CAIXA para enfrentar crises de liquidez internas ou externas, minimizando seus potenciais efeitos na continuidade dos negócios da CAIXA, na sua capacidade de geração de resultado e na sua imagem. O Plano sistematiza os indicadores utilizados para a identificação de situações de crise, as responsabilidades das unidades e instâncias envolvidas na sua execução e os procedimentos a serem seguidos para conduzir a CAIXA a uma situação aceitável ou restabelecer o seu nível de liquidez anterior ao início da crise. A mensuração e o monitoramento dos níveis de exposição ao risco de liquidez são reportados diariamente às Vice-Presidências de Risco e de Finanças e Controladoria, mensalmente, ao Comitê de Risco e, semestralmente, ao Conselho de Administração.	
7.3.5.2	Como é realizado o controle e o monitoramento de limites das estratégias (ex.: *books* tais como volatilidades, direcionais, arbitragens etc)? Com que frequência de atualização?
Não há limites de liquidez por estratégia.	
7.3.6 - Risco Operacional	
7.3.6.1	Descreva a metodologia de gestão do risco operacional.
A identificação, acompanhamento e monitoramento dos riscos operacionais nas atividades de administração de carteiras de valores mobiliários conta com indicadores de efetividade da Política de *Compliance*; indicadores chave de riscos operacionais, com limites de tolerância definidos; e pela realização de testes periódicos de conferência e controle. Além disso, o corpo gerencial e equipe técnica responsáveis como 1ª Linha de Defesa, atuam de modo a identificar, evitar e/ou minimizar as ocorrências por meio de processos de avaliação, recomendação, monitoramento e reporte do risco operacional. Sendo a Vice-Presidência de Risco responsável pela gestão de risco operacional das unidades CAIXA, bem como 2ª linha de defesa.	
7.3.6.2	Descreva os procedimentos de confirmação de ordens executadas e de checagem das posições das carteiras e custódia.
Uma vez que uma ordem é executada, é feito um primeiro batimento dos parâmetros da ordem com a contraparte de execução. Confirmados os parâmetros, um empregado realiza o registro dessa operação nos sistemas de custódia e um segundo empregado confere o registro e confirma o boletamento da operação (sistema de dupla conferência). No dia seguinte, é feita a conciliação entre a posição em carteira de cada fundo esperada pelo sistema de gerenciamento de ordens do Gestor (conforme operações realizadas no dia anterior) e o demonstrativo de patrimônio informado pelo custodiante. Caso sejam verificadas diferenças, são apuradas as causas e realizadas as correções, quando cabíveis.	
7.3.6.3	Descreva os principais pilares dos planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados pela sua empresa.
1) A CAIXA criou em 2004 o Programa de Continuidade dos Negócios – PCN CAIXA, para atuar frente às possíveis interrupções nos serviços prestados aos clientes, como fator fundamental para o sucesso de qualquer iniciativa de preservação ou recomposição da capacidade de realizar negócios. 2) O PCN CAIXA é um processo contínuo e evolutivo composto basicamente por quatro etapas: a) Conhecer a organização; b) Definir as estratégias de continuidade dos negócios; c) Desenvolver e programar ações de respostas tempestivas às interrupções; d) Realizar testes e manutenção dos planos.	

3) De uma maneira simples, o PCN CAIXA envolve o planejamento, a prevenção, a resposta e a recuperação do ambiente produtivo frente a incidentes que podem atingir negativamente seus ativos tangíveis e/ou intangíveis.

4) Desde que o PCN CAIXA foi instituído observa-se grande evolução na maturidade da CAIXA neste domínio, tornando a GCN um complemento da estrutura de gestão de riscos corporativos, no intuito de entender as ameaças e vulnerabilidades das operações de negócio e as consequências geradas por uma interrupção significativa.

5) Hoje o PCN CAIXA se destaca tanto no quesito governança quanto nas questões operacionais e no desenvolvimento de cultura corporativa, fatos estes que tornam a CAIXA referência nacional na GCN.

6) A CAIXA conta com uma moderna Política de Continuidade dos Negócios, totalmente aderente às melhores práticas de mercado, às normas BS 25999 e NBR 15999, e às regulamentações vigentes no Brasil. Nesse sentido, importante destacar que a CAIXA adota os modelos dos institutos internacionais DRII – *Disaster Recovery Institute International* e BCI – *Business Continuity Institute*, tendo em seu quadro de pessoal, o primeiro profissional brasileiro certificado por esses dois institutos internacionais.
Complementar, a gestora VIART possui um Plano de Resposta a Emergências, que tem por objetivo garantir a continuidade dos negócios da VIART em situações de contingência. Os principais pilares do plano de contingência são:

- Preparação de Planos para o pior cenário possível;
- Definição do Local para o ambiente alternativo;
- Ter os recursos necessários para o desenvolvimento das atividades críticas;
- Manutenção dos serviços essenciais;
- Manutenção em servidor de contingência, de Informações essenciais ao Desenvolvimento das atividades críticas e estratégicas.

Cabe a cada empregado disponibilizar Informações consideradas "críticas" (imprescindíveis à realização das atividades) em servidor de contingência próprio da gestora.

7.3.6.4	Descreva a política de segurança da informação.

1) A Política possui caráter estratégico e estabelece as diretrizes para o tratamento e manuseio dos ativos de informação da CAIXA, com o objetivo de disciplinar o seu uso e proteger os dados e informações, visando assegurar a confidencialidade, integridade, autenticidade e disponibilidade da informação corporativa da CAIXA ou sob sua responsabilidade.

2) A Política de Segurança da Informação é aprovada pelo Comitê de Riscos, pelo Conselho Diretor e pelo Conselho de Administração da CAIXA.

3) A Política de SI é observada pelos envolvidos nos processos e atividades em todas as áreas da Instituição. A sua aplicação se dá mediante a prática de ações operacionais planejadas e coordenadas, concretizando-se em procedimentos, parâmetros e metodologia especificados em Normativos e documentos administrativos. As principais diretrizes que norteiam a Política de SI da CAIXA são:

a) Proteção das informações e dados, ativos essenciais para a CAIXA, contra alteração, destruição, divulgação, cópia e impressão não autorizadas, acidentais ou intencionais.
b) Adoção de mecanismos que viabilizem a recuperação da informação como uma das formas de resguardar a continuidade dos negócios da CAIXA.
c) Preservação da confidencialidade das informações armazenadas em sistemas de informação.
d) Adoção de mecanismos que garantam a autenticidade da informação e o não repúdio.

e) Classificação das informações, observados os critérios estabelecidos pela norma de Tratamento da Informação. f) Adoção da prática de "Mesa Limpa e Tela Limpa". g) Conscientização dos clientes e de todos os usuários quanto à importância da segurança da informação. 4) A Política de SI e a norma de Tratamento da Informação são peças fundamentais para a implementação do conceito de Arquitetura de Segurança da Informação, alinhados às iniciativas previstas no Plano Diretor de Segurança da Informação - PDSI da CAIXA, aprovado pelo Comitê de Risco. Esse Plano propõe ações corporativas e integradas para a preservação da SI. 5) A CAIXA integra o Comitê Gestor de Segurança da Informação, vinculado ao Gabinete de Segurança Institucional da Presidência da República. Esse Comitê atua fortemente no desenvolvimento de normas e padrões e na divulgação do tema Segurança da informação para a Administração Pública Federal, direta e indireta. Operacionalmente as informações são classificadas conforme grau de sigilo, observados os critérios estabelecidos pela CAIXA. O acesso à informação é condizente com a necessidade do usuário para o desempenho de suas atribuições na Instituição. Os ambientes onde são tratados dados e Informações são segregados, conforme sua classificação e tipo de uso (Desenvolvimento, homologação, rede, suporte e produção de sistemas Corporativos). Os sistemas da CAIXA possuem trilha de auditoria em razão do grau de sigilo da informação ou por experiência legal. Os empregados conhecem as suas responsabilidades com referência à Segurança da Informação e as informações e recursos disponibilizados pela CAIXA são de uso exclusivo para fins relacionados ao trabalho. Os contratos que impliquem manuseio de Informações da CAIXA ou por ela custodiadas possuem cláusula de confidencialidade, com intuito de garantir a observância da Política de Segurança da Informação e a responsabilização da empresa contratada. Esta política é revisada sempre que necessário, não excedendo o período máximo de 03 anos.	
7.3.6.5	Existe sistema de gravação de ligações telefônicas? Qual a política de escuta das gravações?
Sim. Todos os operadores de mesa tem seus ramais telefônicos gravados. A escuta das gravações é realizada sempre que houver dúvida sobre o entendimento de conversas realizadas. O acesso às gravações é autorizado somente a gestores e à Área de Controle Interno.	
7.3.6.6	Descreva os procedimentos de *back-up* e redundância de informações, *desktops* e servidores (para *back-up*, cite especificamente a periodicidade, local e prazo de armazenamento).
A Gestora conta com equipe destinada exclusivamente para a realização de back-up, com periodicidade diária de todos os documentos produzidos e inseridos no servidor da gestora. Esses documentos são armazenados em servidor alternativo por um período de 15 dias. As Informações e documentos imprescindíveis à realização das atividades são disponibilizadas também em servidor de contingência.	
7.3.6.7	Descreva a política de controle de acesso ao *Data Center* (físico e lógico).
O acesso físico e lógico do Data Center da instituição é realizado apenas por empregados e colaboradores credenciados e autorizados, que atuam na área de Tecnologia da empresa.	
7.3.6.8	Descreva o parque tecnológico atual da instituição. Citar *no-breaks*, capacidade dos servidores, *links* de internet e telefonia etc.
A capacidade de processamento e armazenamento do Parque Tecnológico da CAIXA é de: • 8 mainframes (2 do modelo Z14 e 6 do modelo Z15) • 390.612 MIPS (milhões de instruções por Segundo) no ambiente mainframe; • 20.115 Terabytes de Armazenamento OPEN; • 2.240 Terabytes de Armazenamento Mainframe; • 811 servidores físicos de plataforma baixa;	

• 17.358 servidores lógicos de plataforma baixa; • 23 Servidores físicos de plataforma intermediária; • 06 Silos Robóticos; • 07 Virtual Storage Manager (VSM); • 4.969 Roteadores; • 638 Switches (Centralizado). • 4 circuitos de internet de 10Gbps com dupla abordagem	
7.3.6.9	A instituição possui filtro de e-mail, *firewall* e sistemas de antivírus?
Sim.	
7.3.6.10	São realizados testes periódicos para verificação de segurança e integridade de sistemas? Com que frequência?
Sim. A frequência de realização dos testes para verificação de segurança e integridade de sistemas é mensal.	
8 - Compliance e Auditoria Interna	
8.1	Quem são os responsáveis pelas áreas de *compliance* e auditoria interna e a quem se reportam?
O responsável pela área de *compliance* da VIART (Gestora) é o Gerente Nacional de Governança e Compliance de Ativos de Terceiros. O referido Gerente Nacional reporta-se diretamente ao Vice-Presidente, responsável pela VIART. Já o responsável pela equipe de Auditoria Interna em São Paulo é o Gerente de Filial da Auditoria de São Paulo, que responde à área de Auditoria Geral, unidade que por sua vez responde à Presidência da CAIXA.	
8.2	Descreva o processo para adesão ao Código de Ética e Conduta, bem como suas atualizações, pelas pessoas que trabalham na empresa.
Ao ingressar na Gestora (VIART), cada um dos empregados é orientado a realizar a leitura do Código de Ética da CAIXA e o Código de Conduta da VIART. Em sequência, o empregado assina declaração atestando que recebeu o exemplar do Código de Conduta e tomou ciência do conteúdo dele. O Código de Conduta está publicado em manual normativo interno. Sempre que ocorre alteração, todos os empregados são comunicados.	
8.3	Descreva a política de investimentos pessoais e seu monitoramento.
Segundo o Código de Conduta: Os empregados e dirigentes da VIART devem sempre observar as Diretrizes abaixo quanto aos seus investimentos pessoais:	

Investimentos	Critérios/Condições Específicas	Condições Gerais
Renda Variável Mercado Secundário	Negociações em Bolsa - **Ações (Índice Bovespa), ETF, FII** Negociações de compra e venda devem ser informadas à GERAT00 Não pode haver aquisição de FII/FIP/FIDC administrados ou geridos pela CAIXA/VIART Não pode haver aquisição de ETF sem *Market Maker*	Vedada venda a descoberto de ativos Vedado aluguel de ativos na posição tomadora Vedadas operações intradiárias Vedadas operações com derivativos *Lock-up* de 120 dias a contar da data da aquisição do ativo Vedada a operação de compra e venda diante de Fato Relevante nos 08 dias posteriores à sua publicação Vedada a aquisição de ativos por empregados/dirigentes que participem do Conselho da empresa emissora
Renda Fixa Mercado Secundário	**TPF; CDB/RDB; LF; LCI; LCA; CRI; CRA; Debentures e COE** Negociações de compra e venda devem ser informadas à GERAT00, contendo as evidências de preço *Para CDB/RDB e TPF não há período de lock-up*	
Ativos de Renda Fixa / Renda Variável Mercado Primário	**Ativos acima mencionados** Negociações de compra e venda devem ser informadas à GERAT00 Não pode haver aquisição de ativos em que a CAIXA atue como participante da oferta (coordenadora ou estruturadora) Não pode haver aquisição de FII/FIDC/FIP administrados ou geridos pela CAIXA/VIART Não pode haver aquisição de ativos ofertados com origem/participação de FIP administrados ou geridos pela CAIXA/VIART *Para CDB/RDB e TPF não há período de lock-up*	
Fundos de Investimento	Permitidas aplicações e resgates em Fundos de Investimento administrados e/ou geridos pela VIART e por terceiros Não haverá a necessidade de *lock-up* para fundos que atendam as seguintes condições: - sejam destinados exclusivamente aos funcionários da VIART; - pertençam a Classe RF Curto Prazo ou RF Simples; - Fundos de Investimento administrados e/ou geridos por terceiros; e - Fundos Mútuos de Privatização Não podem se utilizar de recursos de aplicação/resgates retroativo	

RH 169015 #Público

8.4	Existe fundo ou outro instrumento de investimento exclusivo para sócios e executivos da empresa?
Não existe fundo de investimento exclusivo para executivos da empresa.	
8.5	Descreva as regras para investimento dos recursos próprios da empresa.
Devido ao *Chinese Wall*, as regras de investimento dos recursos próprios da CAIXA são definidas em outra Vice Presidência e não se confundem com a gestão de ativos de terceiros.	
8.6	Descreva os procedimentos para o controle de meios de comunicação alternativos ao sistema corporativo visando à administração de conflitos de interesse tais como *front running*, vazamento de informações confidenciais etc. (exemplos de meios de comunicação alternativos: telefone celular, sistemas de mensagens instantâneas e de *webmail* externo)
Os empregados da Gestora que atuam em Mesa de Operações não estão autorizados a utilizarem meios de comunicação alternativos aos sistemas corporativos e ao e-mail corporativo CAIXA em seu ambiente de trabalho, tais como celular e mensagens instantâneas. Adicionalmente, ao ingressarem na Gestora, todos empregados assinam Termos de Confidencialidade responsabilizando-se pela não divulgação de informações confidenciais inerentes às suas atividades.	
8.7	Como são verificados os procedimentos que visem ao combate à lavagem de dinheiro feitos pelos seus distribuidores.
A CAIXA conta com Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento do Terrorismo, disponível no endereço http://www.caixa.gov.br/Downloads/caixa-governanca/Politica-Prevencao-Lavagem-Dinheiro-e-Financiamento-Terrorismo.pdf.	
8.8	Caso a empresa desenvolva outras atividades, descreva sua política de *chinese wall* e de que forma é garantida a proteção de informação entre departamentos que não estejam envolvidos no mesmo projeto ou linha de negócio.
As atividades de gestão, administração, custódia e auditoria são segregadas em atendimento a legislação em vigor. As Resoluções nº 2451 e nº 2486, do Banco Central do Brasil, culminaram com a implantação do "*Chinese Wall*", exigindo a segregação das atividades de gestão e administração de fundos de investimento das demais atividades da instituição. A CAIXA optou por nomear um Vice-Presidente, responsável exclusivamente pelos Fundos de Investimento – VIART, de acordo com o seu Estatuto, aprovado pelo Decreto nº 6.473, de 06 de junho de 2008. Toda a gestão é independente, inclusive com uma mesa de operações própria.	
8.9	No caso de a empresa utilizar serviços de administração, controladoria ou custódia prestados por empresa do mesmo grupo econômico, como se garante a segregação entre a área prestadora de serviço e a gestão de carteiras?
As áreas são segregadas em vice-presidências separadas.	
8.10	Descreva as regras e os procedimentos para monitoramento da divisão de ordens, especificação de comitentes e operações entre carteiras.
A especificação de comitentes é realizada anteriormente à execução das ordens de compra e venda de títulos e valores mobiliários. Quando uma mesma estratégia é adotada simultaneamente para diversos fundos, as operações são divididas conforme política interna de rateio de ordens. Os fundos podem realizar operações entre si respeitando regras, estabelecidas em manual normativo interno, referentes à definição de preço da operação	
8.11	Descreva as regras e procedimentos de monitoramento das operações realizadas fora de plataformas eletrônicas de negociação, enfatizando estabelecimento de preços e fontes de referência utilizadas.
São considerados pelos gestores para precificação de operações realizadas em mercados de balcão minimamente os seguintes aspectos: 1. preços de marcação e intervalo indicativo do fechamento do dia anterior para o ativo em questão ou ativos com maturidade próxima; 2. existência de *spreads* para o ativo em questão, ou ativos com maturidade próxima, em	

outros bancos, corretoras ou plataformas de negociação;
3. existência de *spreads* em ativos ou derivativos de referência, como contratos futuros de juros, que possam balizar a escolha de preço para as ordens de títulos públicos a serem emitidas.
4. *ratings* emitidos internamente ou por agências de risco para títulos de crédito privado;
5. nível de taxa de emissão primária por parte das instituições financeiras;
6. nível de taxa de emissão primária e mercado secundário para títulos de empresas não financeiras.

Por fim, as operações realizadas por fundos em mercados de balcão são verificadas diariamente pela área de risco e controle interno por meio de sistema interno, que compara os preços negociados com o túnel de preços da ANBIMA.

8.12	Existe algum agente externo (ex.: consultoria), além do administrador, envolvido na verificação da adesão a limites de risco, limites legais ou regulamentares das posições dos fundos sob gestão da Empresa?

Sim, custodiantes externos. A Vice-Presidência Fundos de Investimento possui uma área de risco que tem como principal atividade o controle, monitoramento e gerenciamento dos riscos dos fundos de investimento sob sua administração. Os parâmetros para cálculo do risco de mercado bem como os procedimentos a serem adotados no processo de gerenciamento de risco são submetidos para aprovação a um comitê interno constituído por: Vice-Presidente Fundos de Investimento, Diretor de Administração Fiduciária, Diretor e Superintendentes da Gestão de Ativos e Gerente de Risco. A política de risco é compreendida pelos princípios gerais, e diretrizes específicas de ações relativas ao risco. Também determina os processos operacionais mais importantes, limites, objetivos de performance baseados no risco e os procedimentos para o gerenciamento de risco,.

8.13	Descreva como são tratados os conflitos de interesse resultantes da participação ou atuação dos sócios ou executivos em outros negócios, bem como de sua eventual participação em Conselhos Fiscais e de Administração.

A VIART é uma vice-presidência segregada das demais e não integra o Conselho Diretor, conforme artigo 13, § 4º e artigo 28 do Estatuto da CAIXA. Dessa forma, eventuais situações de conflito de interesse relacionadas às demais atividades desempenhadas pela instituição são mitigadas por meio de estruturas de governança que contam com comitês segregados, assegurando que a tomada de decisão ocorra de forma colegiada e independente. Além disso, o estatuto prevê a existência do Conselho de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros, órgão colegiado deliberativo, responsável pela gestão e representação da CAIXA quanto às atividades da VIART.

O Código de Ética da CAIXA, o Código de Conduta de Empregados e Dirigentes da CAIXA e o Código de Conduta dos Empregados da VIART, além das Diretrizes de nomeação de representantes em participações acionárias ou instrumentos de dívidas detidos por fundos de investimento ou carteiras administradas, geridos e/ou administrados pela Vice-presidência de Fundos de Investimento (VIART) dispõem sobre situações de potenciais conflitos de interesse.

A Política de Governança Corporativa da CAIXA e suas subsidiárias é pautada por diretizes que visam mitigar potenciais ocorrências de conflitos de interesses, com monitoramento constante e criterioso da exposição a riscos, onde conflitos de interesse apresentem alta probabilidade de ocorrência. Norteada pela apllicação de regras de governança corporativa que privilegiem a deliberação colegiada, evitem o conflito de interesses e resguardem os interesses da CAIXA e de suas subsidiárias. Os tomadores de decisão conduzem-se de forma a prevenir a ocorrência de quaisquer situações que possam, de alguma forma, caracterizar conflito de interesses e afetar os negócios, serviços e demais operações da CAIXA e de suas subsidiárias. Os papéis e responsabilidades de todos os tomadores de decisão da CAIXA são claramente definidos, assegurada a apropriada segregação de funções, inclusive com a definição das alçadas de decisão de cada instância, de forma a minimizar possíveis focos de conflitos de interesses.

Qualquer situação gerada pelo confronto entre interesses da CAIXA e interesse pessoal, que possa comprometer o interesse coletivo ou influenciar o desempenho da função pública, é pautada no Código de Conduta dos empregados e dirigentes da CAIXA, ao qual todos estão submetidos, e sua eventual violação ocasionará a abertura de procedimento de apuração de responsabilidade civil e disciplinar. A participação em Conselhos Fiscais e de Administração também está pautada no Código de Conduta e ocorrerá somente mediante indicação aprovada por órgãos deliberativos da CAIXA, na representação dos interesses dos fundos de investimento, administrados ou geridos pela CAIXA, nos termos da Lei nº 6.404, de 15/12/1976,.	
8.14	Descreva as regras para o tratamento de *soft dollar* tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.
É vedado, no Código de Conduta, aos empregados e dirigentes, em razão de suas atribuições, aceitar favores, comissões, gratificações, vantagens financeiras ou materiais, doações, brindes ou presentes de qualquer natureza, para si ou para outras pessoas, que possam influenciar decisões, facilitar negócios, beneficiar terceiros, ou causar prejuízo de imagem à Empresa.	
8.15	A empresa recebe comissões para alocação por investimentos em títulos e valores mobiliários distribuídos em balcão? Quais as regras? Favor tratar o assunto de rebates de taxas de administração e performance sobre fundos investidos pagos ao gestor de forma específica.
Não.	
8.16	São realizados testes periódicos para verificação de conformidade com políticas internas? Com que frequência?
A Conformidade para verificação das políticas internas é efetuada de acordo com o produto/ processo envolvido, podendo ser diária ou mensal. São realizados testes periódicos pela área de Controle Interno da VIART, relacionados às atividades/rotinas críticas executadas pelas áreas vinculadas à Vice-Presidência de Fundos de Investimento da CAIXA.	
9 - Questões Jurídicas e Legais	
9.1	Descreva como são tratadas as questões jurídicas e legais da empresa (departamento jurídico próprio ou consultoria de terceiros)
As questões jurídicas e legais da empresa são tratadas por um departamento jurídico próprio.	
9.2	A empresa ou algum de seus dirigentes já foram punidos pela CVM, pelo Banco Central ou pelo Conselho de Recursos do Sistema Financeiro? Se positivo, informar o número do processo.
Não.	
9.3	Existe algum processo contra a Empresa ou algum de seus dirigentes na CVM, no Banco Central ou no Conselho de Recursos do Sistema Financeiro?
Não.	

10 - Anexos		Marcar Anexos Abaixo
10.1	Resumo Profissional	SIM
10.2	Manual de Risco	CONFIDENCIAL
10.3	Manuais de Marcação a Mercado	SIM
10.4	Manual de Compliance	CONFIDENCIAL
10.5	Código de Ética e Conduta	SIM
10.6	Manual de Política de Exercício de Direito de Voto (*Proxy Voting*)	SIM
10.7	Relatório de Rating	SIM
10.8	Manual de Liquidez	CONFIDENCIAL
10.9	Política de *Suitability*	CONFIDENCIAL

2) Declaração

Declaramos que este questionário foi preenchido, revisado e assinado por pessoas devidamente autorizadas a fazê-lo, respondendo esta instituição pela sua exatidão, veracidade e integridade da informação de todo o conteúdo prestado neste documento e de seus anexos.

Comprometemo-nos a manter todas as informações deste questionário devidamente atualizadas semestralmente, enviando nova versão do questionário aos distribuidores e alocadores nos meses de janeiro e julho, com data-base dezembro e junho, com exceção das informações contidas no Item 3 – Eventos Importantes, as quais serão atualizadas e comunicadas imediatamente após a sua ocorrência.

Local: SÃO PAULO	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes

1 - Qualquer alteração em alguma questão dessa seção deve ser informada imediatamente após sua efetivação, com a indicação da referida data.

1.1	Mudança societária que altere o controle acionário da empresa.
N/A	
1.2	Entrada e saída dos principais sócios.
Posse do novo presidente da Caixa Econômica Federal – 07/01/2019 – Pedro Guimarães.	
1.3	Alteração no quadro de profissionais responsáveis pelas atividades da empresa gestora, incluindo compliance e risco.
N/A	
2 - Alterações desde a última atualização	
2.1	Data da última atualização.
30/06/2020.	
2.2	Quais foram os fatos relevantes da empresa gestora desde a última atualização?
N/A	
2.3	Liste os itens alterados desde a última atualização do questionário.
(Devido a ampla revisão do Questionário, sugerimos a leitura integral do documento)	

TERMO DE ANÁLISE E ATESTADO DE CREDENCIAMENTO DO ADMINISTRADOR OU GESTOR DE FUNDO QUE ATENDA AO PREVISTO NO ART. 15, § 2º, I, DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3922/2010

Nos termos do inciso VI do art. 1º da Resolução CMN nº 3.922/2010, alterada pela Resolução CMN nº 4.695, de 25 de novembro de 2018, os responsáveis pela gestão do Regime Próprio de Previdência Social (RPPS) deverão realizar o prévio credenciamento da instituição administradora dos fundos de investimento em que serão aplicados os recursos do regime. O § 3º do art. 1º da Resolução dispõe que credenciamento deverá observar, dentre outros critérios, o histórico e experiência de atuação, o volume de recursos sob a gestão e administração da instituição, a solidez patrimonial, a exposição a risco reputacional, padrão ético de conduta e aderência da rentabilidade a indicadores de desempenho. Os parâmetros para credenciamento estão previstos no art. 3º, §§ 1º e 2º, da Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, sendo que o art. 6º-E, dispõe que *"a análise das informações relativas à instituição credenciada e a verificação dos requisitos mínimos estabelecidos para o credenciamento deverão ser registradas em Termo de Análise de Credenciamento"* e de *"Atestado de Credenciamento"*, conforme modelos disponibilizados no site da SPREV.

A principal alteração promovida pela Resolução CMN nº 4.695/2018 é permitir novas aplicações de recursos dos RPPS apenas em fundos de investimento em que o administrador ou gestor do fundo seja instituição autorizada a funcionar pelo BACEN, obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos, nos termos da regulamentação do CMN (art. 15, § 2º, I, da Resolução CMN nº 3.922/2010). O comitê de auditoria, de que trata a Resolução CMN nº 3.198, de 2004, é órgão estatutário fundamental ligado à alta administração das instituições, e tem como objetivo estabelecer as melhores práticas de governança corporativa relacionadas a todas as atividades desempenhadas em seu ambiente de negócio. As instituições financeiras obrigadas a constituir comitê de riscos, por sua vez, devem reforçar as práticas de governança no gerenciamento de riscos de suas operações, inclusive aqueles relacionados à prestação dos serviços de administração dos fundos de investimentos e de carteiras de valores mobiliários, nos termos da Resolução CMN nº 4.557, de 2017.

Na prática do mercado, essas condições estão mais relacionadas aos administradores dos fundos de investimento, aos quais, adicionalmente ao requisito dos comitês de auditoria e de riscos, os recursos oriundos de RPPS sob sua administração devem representar no máximo 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração, com o objetivo de que os administradores elegíveis apresentem maior diversificação de seu campo de atuação e evidenciem reconhecida confiança e competência na administração de recursos de terceiros pelo mercado.

Por meio do Ofício Circular Conjunto nº 2/2018/CVM/SIN/SPREV[1], a SPREV e a CVM orientaram os gestores de RPPS e prestadores de serviço dos fundos sobre a aplicação desses critérios, que previu, com base no art. 23-A da Resolução CMN nº 3.922/2010, que "a lista das instituições que atendem aos requisitos do inciso I do § 2º e do § 8º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010, com a redação dada pela Resolução nº 4.695/2018, será divulgada no sítio da SPREV (www.previdencia.gov.br/regimes-proprios/investimentos-do-rpps/)". A lista divulgada pela SPREV, foi confeccionada com base nas informações repassadas pelo BACEN e refere-se às instituições registradas pela CVM nos termos da Instrução CVM nº 558/2015. Foram divulgadas também orientações adicionais sobre lista[2] e a atualização da nota técnica relativa as perguntas e respostas sobre a Resolução CMN[3].

Considerando que o objetivo do CMN ao incluir esses requisitos para as aplicações dos RPPS foi de conferir maior proteção e segurança a essas alocações, sem prejudicar a rentabilidade, os custos e a sua transparência, que a lista das instituições que atendem aos critérios previstos nos incisos I e II do § 2º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010 é taxativa e divulgada pela SPREV, entendeu-se que, a princípio, poder-se-ia aplicar a essas instituições um modelo mais simplificado de Termo de Análise de Credenciamento. A utilização desse modelo não afasta a responsabilidade dos dirigentes do RPPS pela criteriosa análise do fundo de investimento que receberá os recursos do RPPS, assim, deve também ser efetuada uma análise individualizada de cada fundo de investimento, conforme modelo "Formulário de Análise de Fundo de Investimento", a ser anexada ao presente termo (contudo, isso poderá ocorrer oportunamente, em data mais próxima à decisão de investimento).

---

[1] Disponível em http://www.cvm.gov.br/legislacao/oficios-circulares/sin/oc-sin-sprev-0218.html

[2] http://sa.previdencia.gov.br/site/2018/12/Esclarecimento-a-respeito-das-instituicoes-elegiveis .pdf

[3] http://sa.previdencia.gov.br/site/2018/12/Perguntas-e-Respostas-Resolucao-CMN-2018.12.10-Versao-04.pdf

TERMO DE ANÁLISE DE CREDENCIAMENTO ADMINISTRADOR OU GESTOR DE FUNDO DE INVESTIMENTO [4/5]

Número do Termo de Análise de Credenciamento		/2021
Número do Processo (Nº protocolo ou processo)		

I - REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL – RPPS

Ente Federativo		CNPJ	
Unidade Gestora do RPPS		CNPJ	

II - Instituição a ser credenciada:		**Administrador:**		**Gestor:**	
Razão Social	Caixa Econômica Federal	CNPJ			00.360.305/0001-04
Endereço	AV. PAULISTA 2300 – 11 ANDAR– São Paulo/SP	Data Constituição			12/01/1861
E-mail (s)	geico@caixa.gov.br	Telefone (s)			(11) 3572-4600
Data do registro na CVM	1/4/1995	Categoria (s)	Administrador / Gestor		
Data do registro no BACEN	7/21/1964	Categoria (s)	Caixa Econômica Federal		

Principais contatos com RPPS	Cargo	E-mail	Telefone
Júlio Alves Bittencourt	Gerente Executivo	julio.bittencourt@caixa.gov.br	(11) 3572-4600
Ciro Augusto Miguel	Gerente Executivo	ciro.miguel@caixa.gov.br	(11) 3572-4600
Gilmar Chapiewsky	Gerente Executivo	gilmar.chapiewsky@caixa.gov.br	(11) 3572-4600
Vinicius Tonidandel Borini	Gerente Executivo	vinicius.borini@caixa.gov.br	(11) 3572-4600

Atende ao previsto nos incisos I e II do § 2º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010? [6]

SIM	X	NÃO	

Relação dos documentos referentes à análise da Instituição (art. 6º-E, III, Portaria MPS nº 519/2011):

Identificação do documento analisado	Data de validade das certidões	Página da internet em que o documento foi consultado ou disponibilizado pela instituição
1. Certidão da Fazenda Municipal		http://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Certidão da Fazenda Estadual ou Distrital		
3. Certidão de Débitos relativos a Créditos Tributários Federais e à Dívida Ativa da União		
4. Certidão quanto a Contribuições para o FGTS		

III - Parecer final quanto ao credenciamento da Instituição:	

IV - Classificação de Fundo(s) de Investimento para os quais a Instituição foi credenciada

	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

V - Fundo(s) de Investimento administrado(s)/gerido(s) pela instituição para futura decisão de investimento:[3]	CNPJ	Data da Análise
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	30.068.224/0001-04	
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	05.164.358/0001-73	
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.117/0001-84	
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.769.135/0001-44	
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.088/0001-50	
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.288/0001-03	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.139.595/0001-76	
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.791.074/0001-26	
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.768.682/0001-05	
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.139.534/0001-00	
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.769.046/0001-06	
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.042/0001-31	
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	30.068.169/0001-44	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	34.660.276/0001-18	
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	15.154.236/0001-50	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	13.058.816/0001-18	
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	03.737.217/0001-77	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.503/0001-88	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.061.217/0001-28	
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	21.918.896/0001-62	
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.508.605/0001-00	
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.215.008/0001-70	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	05.164.356/0001-84	
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	10.551.375/0001-01	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	10.577.512/0001-79	
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	30.068.060/0001-07	
CAIXA IBOVESPA FIC AÇÕES	01.525.057/0001-77	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	10.551.382/0001-03	
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	14.120.520/0001-42	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	10.646.895/0001-90	
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	39.528.038/0001-77	
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	03.914.671/0001-56	
CAIXA PETROBRAS PRÉ-SAL FI AÇÕES	11.060.594/0001-42	
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	17.098.794/0001-70	
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	05.164.364/0001-20	
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.154.220/0001-47	
CAIXA SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL ISE FI AÇÕES	08.070.838/0001-63	
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	04.885.820/0001-69	
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.154.441/0001-15	
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	14.507.699/0001-95	
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	30.068.135/0001-50	
CAIXA INDEXA SHORT DÓLAR FI MULTIMERCADO LP	28.157.511/0001-01	
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	18.007.358/0001-01	
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	35.536.532/0001-22	

Data:

Responsáveis pelo Credenciamento:	Cargo	CPF	Assinatura
Zoraya Vieira dos Santos Zarinho	Diretora adm.	060209763.00	
Yordas de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	

[4] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

[5] Somente para instituição que atenda ao previsto nos incisos I e II do § 2º ou § 8º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010, conforme relação disponibilizada pela SPREV em http://www.previdencia.gov.br/regimes-proprios/investimentos-do-rpps/ .

[6] Anexar relação disponibilizada pela SPREV.

[7] Anexar o Formulário de Análise do Fundo de Investimento referente a cada fundo/produto que poderá ser objeto de alocação por parte do RPPS. (Esse formulário de análise do fundo poderá ser anexado/atualizado posteriormente, em data tempestiva à decisão de investimento).

TERMO DE ANÁLISE E ATESTADO DE CREDENCIAMENTO DO ADMINISTRADOR OU GESTOR DE FUNDO QUE ATENDA AO PREVISTO NO ART. 15, § 2º, I, DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3922/2010

Nos termos do inciso VI do art. 1º da Resolução CMN nº 3.922/2010, alterada pela Resolução CMN nº 4.695, de 25 de novembro de 2018, os responsáveis pela gestão do Regime Próprio de Previdência Social (RPPS) deverão realizar o prévio credenciamento da instituição administradora dos fundos de investimento em que serão aplicados os recursos do regime. O § 3º do art. 1º da Resolução dispõe que credenciamento deverá observar, dentre outros critérios, o histórico e experiência de atuação, o volume de recursos sob a gestão e administração da instituição, a solidez patrimonial, a exposição a risco reputacional, padrão ético de conduta e aderência da rentabilidade a indicadores de desempenho. Os parâmetros para credenciamento estão previstos no art. 3º, §§ 1º e 2º, da Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, sendo que o art. 6º-E, dispõe que *"a análise das informações relativas à instituição credenciada e a verificação dos requisitos mínimos estabelecidos para o credenciamento deverão ser registradas em Termo de Análise de Credenciamento"* e de *"Atestado de Credenciamento"*, conforme modelos disponibilizados no site da SPREV.

A principal alteração promovida pela Resolução CMN nº 4.695/2018 é permitir novas aplicações de recursos dos RPPS apenas em fundos de investimento em que o administrador ou gestor do fundo seja instituição autorizada a funcionar pelo BACEN, obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos, nos termos da regulamentação do CMN (art. 15, § 2º, I, da Resolução CMN nº 3.922/2010). O comitê de auditoria, de que trata a Resolução CMN nº 3.198, de 2004, é órgão estatutário fundamental ligado à alta administração das instituições, e tem como objetivo estabelecer as melhores práticas de governança corporativa relacionadas a todas as atividades desempenhadas em seu ambiente de negócio. As instituições financeiras obrigadas a constituir comitê de riscos, por sua vez, devem reforçar as práticas de governança no gerenciamento de riscos de suas operações, inclusive aqueles relacionados à prestação dos serviços de administração dos fundos de investimentos e de carteiras de valores mobiliários, nos termos da Resolução CMN nº 4.557, de 2017.

Na prática do mercado, essas condições estão mais relacionadas aos administradores dos fundos de investimento, aos quais, adicionalmente ao requisito dos comitês de auditoria e de riscos, os recursos oriundos de RPPS sob sua administração devem representar no máximo 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração, com o objetivo de que os administradores elegíveis apresentem maior diversificação de seu campo de atuação e evidenciem reconhecida confiança e competência na administração de recursos de terceiros pelo mercado.

Por meio do Ofício Circular Conjunto nº 2/2018/CVM/SIN/SPREV[1], a SPREV e a CVM orientaram os gestores de RPPS e prestadores de serviço dos fundos sobre a aplicação desses critérios, que previu, com base no art. 23-A da Resolução CMN nº 3.922/2010, que "a lista das instituições que atendem aos requisitos do inciso I do § 2º e do § 8º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010, com a redação dada pela Resolução nº 4.695/2018, será divulgada no sítio da SPREV (www.previdencia.gov.br/regimes-proprios/investimentos-do-rpps/)". A lista divulgada pela SPREV, foi confeccionada com base nas informações repassadas pelo BACEN e refere-se às instituições registradas pela CVM nos termos da Instrução CVM nº 558/2015. Foram divulgadas também orientações adicionais sobre lista[2] e a atualização da nota técnica relativa as perguntas e respostas sobre a Resolução CMN[3].

Considerando que o objetivo do CMN ao incluir esses requisitos para as aplicações dos RPPS foi de conferir maior proteção e segurança a essas alocações, sem prejudicar a rentabilidade, os custos e a sua transparência, que a lista das instituições que atendem aos critérios previstos nos incisos I e II do § 2º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010 é taxativa e divulgada pela SPREV, entendeu-se que, a princípio, poder-se-ia aplicar a essas instituições um modelo mais simplificado de Termo de Análise de Credenciamento. A utilização desse modelo não afasta a responsabilidade dos dirigentes do RPPS pela criteriosa análise do fundo de investimento que receberá os recursos do RPPS, assim, deve também ser efetuada uma análise individualizada de cada fundo de investimento, conforme modelo "Formulário de Análise de Fundo de Investimento", a ser anexada ao presente termo (contudo, isso poderá ocorrer oportunamente, em data mais próxima à decisão de investimento).

---

[1] Disponível em http://www.cvm.gov.br/legislacao/oficios-circulares/sin/oc-sin-sprev-0218.html

[2] http://sa.previdencia.gov.br/site/2018/12/Esclarecimento-a-respeito-das-instituicoes-elegiveis .pdf

[3] http://sa.previdencia.gov.br/site/2018/12/Perguntas-e-Respostas-Resolucao-CMN-2018.12.10-Versao-04.pdf

TERMO DE ANÁLISE DE CREDENCIAMENTO ADMINISTRADOR OU GESTOR DE FUNDO DE INVESTIMENTO [4/5]

Número do Termo de Análise de Credenciamento		/2021
Número do Processo (Nº protocolo ou processo)		

I - REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL – RPPS

Ente Federativo		CNPJ	
Unidade Gestora do RPPS		CNPJ	

II - Instituição a ser credenciada:		**Administrador:**		**Gestor:**	
Razão Social	Caixa Econômica Federal	CNPJ			00.360.305/0001-04
Endereço	AV. PAULISTA 2300 – 11 ANDAR– São Paulo/SP	Data Constituição			12/01/1861
E-mail (s)	geico@caixa.gov.br	Telefone (s)			(11) 3572-4600
Data do registro na CVM	1/4/1995	Categoria (s)	Administrador / Gestor		
Data do registro no BACEN	7/21/1964	Categoria (s)	Caixa Econômica Federal		

Principais contatos com RPPS	Cargo	E-mail	Telefone
Júlio Alves Bittencourt	Gerente Executivo	julio.bittencourt@caixa.gov.br	(11) 3572-4600
Ciro Augusto Miguel	Gerente Executivo	ciro.miguel@caixa.gov.br	(11) 3572-4600
Gilmar Chapiewsky	Gerente Executivo	gilmar.chapiewsky@caixa.gov.br	(11) 3572-4600
Vinicius Tonidandel Borini	Gerente Executivo	vinicius.borini@caixa.gov.br	(11) 3572-4600

Atende ao previsto nos incisos I e II do § 2º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010?[6]

SIM	X	NÃO	

Relação dos documentos referentes à análise da Instituição (art. 6º-E, III, Portaria MPS nº 519/2011):

Identificação do documento analisado	Data de validade das certidões	Página da internet em que o documento foi consultado ou disponibilizado pela instituição
1. Certidão da Fazenda Municipal		http://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Certidão da Fazenda Estadual ou Distrital		
3. Certidão de Débitos relativos a Créditos Tributários Federais e à Dívida Ativa da União		
4. Certidão quanto a Contribuições para o FGTS		

III - Parecer final quanto ao credenciamento da Instituição:	

IV - Classificação de Fundo(s) de Investimento para os quais a Instituição foi credenciada

	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

V - Fundo(s) de Investimento administrado(s)/gerido(s) pela instituição para futura decisão de investimento:[7]	CNPJ	Data da Análise
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	30.068.224/0001-04	
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	05.164.358/0001-73	
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.117/0001-84	
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.769.135/0001-44	
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.088/0001-50	
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.288/0001-03	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.139.595/0001-78	
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.791.074/0001-26	
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.768.682/0001-05	
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.139.534/0001-00	
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.769.046/0001-06	
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.598.042/0001-31	
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	30.068.169/0001-44	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	34.660.276/0001-18	
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	15.154.236/0001-50	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	13.058.316/0001-18	
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	03.737.217/0001-77	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.503/0001-88	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.061.217/0001-28	
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	21.918.896/0001-62	
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.508.605/0001-00	
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.215.008/0001-70	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	05.164.356/0001-84	
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	10.551.375/0001-01	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	10.577.512/0001-79	
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	30.068.060/0001-07	
CAIXA IBOVESPA FIC AÇÕES	01.525.057/0001-77	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	10.551.382/0001-03	
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	14.120.529/0001-42	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	10.646.895/0001-90	
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	39.528.038/0001-77	
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	03.914.671/0001-56	
CAIXA PETROBRAS PRÉ-SAL FI AÇÕES	11.060.594/0001-42	
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	17.098.794/0001-70	
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	05.164.364/0001-20	
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.154.220/0001-47	
CAIXA SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL ISE FI AÇÕES	08.070.838/0001-63	
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	04.885.870/0001-69	
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.154.441/0001-15	
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	14.507.699/0001-95	
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	30.068.135/0001-50	
CAIXA INDEXA SHORT DÓLAR FI MULTIMERCADO LP	29.157.511/0001-01	
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	18.007.358/0001-01	
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	35.536.532/0001-22	

Data:

Responsáveis pelo Credenciamento:	Cargo	CPF	Assinatura
Zaqueu Cleide dos Santos Zaqueu	Diretora administrativa	060209763-00	Cleide
Yandara de Souza Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	Yandara

[4] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

[5] Somente para instituição que atenda ao previsto nos incisos I e II do § 2º ou § 8º do art. 15 da Resolução CMN nº 3.922/2010, conforme relação disponibilizada pela SPREV em http://www.previdencia.gov.br/regimes-proprios/investimentos-do-rpps/ .

[6] Anexar relação disponibilizada pela SPREV.

[7] Anexar o Formulário de Análise do Fundo de Investimento referente a cada fundo/produto que poderá ser objeto de alocação por parte do RPPS. (Esse formulário de análise do fundo poderá ser anexado/atualizado posteriormente, em data tempestiva à decisão de investimento).

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância das condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à naturezas de suas obrigações e transparência e os requisitos e limites previstos na Resolução do CMN, a aderência à Política Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	05.164.358/0001-73
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	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
X	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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	11/11/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	01/04/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das Informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	16/07/2002	Data de Início das Atividades:	01/11/2005
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	CDI	
	Investe em carteira composta por títulos de emissão do Tesouro Nacional e/ou do Banco Central do Brasil em operações finais e/ou compromissadas, lastreadas em títulos públicos federais.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	112	312.796.750,94	4,266301	2,73%	2,76%	98,95%
2019	94	260.996.575,86	4,152971	5,92%	5,96%	99,29%
201	103	280.537.079,37	3,920937	6,12%	6,42%	95,32%
201	109	310.182.257,40	3,694777	9,87%	9,93%	99,43%
201	120	319.672.029,44	3,362909	14,00%	14,00%	99,99%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	59,84%
	Operação compromissada	40,16%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	20,0
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo investe em títulos públicos federais, atualmente tem alta exposição em títulos públicos pré-fixados e pós fixados de curto prazo. Por conta disto, é considerado um fundo extremamente conservador.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Vilenda dos Santos Marinho	Diretora Administrativa	060209763.00	
Jordas de Sousa Menezes	Fiscal Gestor de Recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	35.536.532/0001-22
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	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
X	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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	23/09/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	N/A	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	23/09/2019	Data de Início das Atividades:	15/04/2020
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IPCA	
	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do CAIXA MASTER ATIVA FI RENDA FIXA LP, CNPJ: 35.536.520/0001-06.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+1 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	1 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,40%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	*Frequência*	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	102	787.283.906,54	1.036,046219			
2019						
201						
201						
201						

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Fundos de Investimento	100,03%
	Valores a pagar/receber	-0,03%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1. 35.536.520/0001-06	Art. 7º, IV, "a"	100,03%
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	12,2
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo pode investir em títulos públicos federais pré-fixados (IRF-M), pós-fixados (IMA-S) e atrelados a inflação (IMA-B), conforme o entendimento dos seus gestores. O prazo médio de carteira do fundo também não é previamente definido, dependerá da conjuntura econômica. Os gestores do fundo adotam uma gestão ativa dos investimentos, migrando entre as possibilidades citadas, tentando superar o mercado em momentos de crescimento e se proteger em momentos de queda.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Mariana Oleide dos Santos Marinho	Diretora administrativa	060209763.00	Oleide
Yordas de Sousa Oliveira	Gestor de Recursos	048.086.153-63	Yordas

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	10.577.503/0001-88
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	18/10/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das Informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	05/12/2008	Data de Início das Atividades:	18/04/2012
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B 5+	
	Investe em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	322	1.733.830.686,04	2,811806	5,23%	5,50%	95,19%
2019	362	2.752.338.613,28	2,671975	29,73%	30,37%	97,91%
201	197	1.231.561.219,42	2,059570	14,98%	15,41%	97,22%
201	198	915.100.426,22	1,791286	12,44%	12,75%	97,55%
201	200	743.094.017,55	1,593137	30,56%	31,04%	98,45%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Títulos Federais	94,17%
	Operação compromissada	5,84%
	Valores a pagar/receber	0,00%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	154,7
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo investe em títulos públicos federais, atrelados a inflação (NTN-B), mantendo um prazo médio de carteira superior a cinco anos. É um fundo extremamente volátil, indicado mais para investidores agressivos.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Glenda dos Santos Marinho	Diretora administrativa	060209763.00	Glenda
Jordan de Sousa Alencar	Gestor de Recursos	048.086.153 63	Jordan

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	10.740.670/0001-06
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	25/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	03/03/2009	Data de Início das Atividades:	28/05/2010
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IRF-M 1	
	Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	1361	16.753.976.831,37	2,613017	3,63%	3,84%	94,52%
2019	1361	10.910.469.036,62	2,521460	6,55%	6,76%	96,93%
201	1477	18.338.157.565,12	2,366414	6,81%	6,97%	97,57%
201	1412	17.173.437.880,47	2,215635	10,93%	11,12%	98,33%
201	1340	12.149.877.506,14	1,997268	14,58%	14,72%	99,07%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Operação compromissada	77,00%
	Títulos Federais	23,00%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	0,9
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo investe em títulos públicos federais, pré-fixados que tenham prazo de vencimento inferior a um ano. É um dos fundos menos voláteis disponíveis, sendo voltado para maior "proteção" de carteira.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Aleide dos Santos Marinho	Diretora	060209763.00	Aleide
Jordas de Sousa Menezes	Gestão de Recursos	018.086.153-63	Jordas

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	23.215.097/0001-55
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	06/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	18/08/2015	Data de Início das Atividades:	04/11/2016
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IPCA	
	Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ: 10.948.555/0001-13.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,40%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	*Frequência*	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	885	14.722.139.597,34	1,514367	6,66%	4,52%	147,53%
2019	695	9.818.666.120,10	1,419747	16,43%	4,31%	381,62%
201	345	3.163.516.828,54	1,219372	7,82%	3,75%	208,65%
201	114	685.593.312,38	1,130984	11,22%	2,95%	380,58%
201	29	135.615.483,49	1,016913			

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Fundos de Investimento	99,73%
	Operação compromissada	0,27%
	Valores a pagar/receber	0,00%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
1.	11.060.913/0001-10	Art. 7º, I, "b"	50,00%
2.	10.740.670/0001-06	Art. 7º, I, "b"	42,83%
3.	14.508.605/0001-00	Art. 7º, I, "b"	6,91%
4.			
5.			

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	6,9
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo pode investir em títulos públicos federais pré-fixados (IRF-M), pós-fixados (IMA-S) e atrelados a inflação (IMA-B), conforme o entendimento dos seus gestores. O prazo médio de carteira do fundo também não é previamente definido, dependerá da conjuntura econômica. Os gestores do fundo adotam uma gestão ativa dos investimentos, migrando entre as possibilidades citadas, tentando superar o mercado em momentos de crescimento e se proteger em momentos de queda.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Verde dos Santos Moreira	Diretora administrativa	06020976300	Verde
Ygordas de Sousa Menezes	Gestor de recursos	048086153 63	Ygordas

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	14.386.926/0001-71
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	26/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

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 2A	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saida	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	1005	10.655.087.063,09	2,397167	8,03%		
2019	964	8.750.821.084,96	2,218947	11,19%		
201	732	7.593.758.539,71	1,995668	9,30%		
20[illegible]	619	4.324.047.951,59	1,825813	12,34%		
20[illegible]	620	3.699.856.942,99	1,625234	14,94%		

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	95,55%
	Operação compromissada	4,45%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	23,6
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo investe em títulos públicos federais atrelados a inflação (NTN-B), mantendo o prazo de carteira constante em dois anos. É um fundo voltado para perfil de investidor conservador.

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
Zaqueu Vicente dos Santos Zaquinho	Diretora administrativa	060209763.00	
Yordas de Sousa Mendes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	11.060.913/0001-10
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	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=fundosre
3. Lâmina de informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

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	IMA-B5	
	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 do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	20.761.505.098,56	3,228834	7,75%		
2019	923	9.819.854.122,58	2,996681	12,85%		
201	724	11.498.930.142,73	2,655342	9,67%		
201	703	6.666.405.048,53	2,421265	12,38%		
201	713	5.450.485.822,27	2,154503	15,19%		

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	97,68%
	Operação compromissada	2,32%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	26,8
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo investe em títulos públicos federais, atrelados a inflação (NTN-B), mantendo um prazo médio de carteira inferior a cinco anos. É a opção mais conservadora, dentro da classe dos IMA-B.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Vicente dos Santos Aparicio	Diretora administrativa	060209763.00	
Yordas de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância das condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, exatidão, adequação à natureza de suas obrigações e transparência e os requisitos e limites previstos na Resolução do CMN, a aderência à Política Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	10.740.658/0001-93
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	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=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	02/04/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	03/03/2009	Data de Início das Atividades:	08/03/2010
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	*Frequência*	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	899	6.193.173.925,17	3,694048	6,06%	6,41%	94,63%
2019	949	6.698.026.543,95	3,482918	22,59%	22,95%	98,43%
201	643	3.494.713.719,64	2,841117	12,84%	13,06%	98,30%
201	722	4.084.421.859,82	2,517896	12,55%	12,79%	98,09%
201	721	4.724.619.896,78	2,237140	24,56%	24,81%	98,99%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	94,93%
	Operação compromissada	5,06%
	Valores a pagar/receber	0,01%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	96,0
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo é referenciado IMA-B, ou seja, busca replicar o desempenho deste benchmark, então investe integralmente em títulos públicos federais atrelados a inflação (NTN-B).

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Vilenda dos Santos Nascimento	Diretora administrativa	260.209.763-00	Vilenda
Jordan de Sousa Menezes	Gestor de recursos	048.086.153-63	Jordan

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			CNPJ FUNDO	21.918.896/0001-62
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	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"
X	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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	01/03/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	27/01/2015	Data de Início das Atividades:	17/04/2015
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IPCA+6%	
	Aplica seus recursos em ativos financeiros expostos diretamente ao risco das variações das taxas de juros pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	18/04/2018	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE CREDITO ; RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	76	199.070.839,42	1,874882	7,59%	10,76%	70,49%
2019	76	187.928.458,22	1,742676	16,48%	10,59%	155,66%
201	77	151.751.036,37	1,496064	7,73%	9,92%	77,94%
201	100	227.474.588,63	1,388698	9,42%	9,05%	104,15%
201	100	207.884.027,58	1,269101	16,84%	12,64%	133,27%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Títulos Federais	84,40%
	Operação compromissada	9,47%
	Títulos Privados	6,14%
	Valores a pagar/receber	0,00%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
	17.184.037/0001-10	Instituição Financeira	6,14%

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)	27,7
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo pode investir em títulos públicos e em títulos privados. Atualmente, mantém um posição elevada em títulos públicos federais atrelados a inflação (NTN-B), com prazos de vencimentos inferiores a cinco anos (IMA-B5). Inclusive, o fundo apresenta desempenho histórico muito similar ao IMA-B5.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Neuda dos Santos Barreiros Gonçalves de Sousa	Diretora administrativa	060.209.763-00	Neuda
Alencar	Gestor de Recursos	048.086.153-63	Gonçalves

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	14.508.605/0001-00
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	26/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

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	IRF-M	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	445	3.566.953.490,56	2,355160	6,43%	6,69%	96,06%
2019	443	14.821.342.261,54	2,212849	11,68%	12,03%	97,11%
201	350	2.378.694.859,16	1,981372	10,71%	10,73%	99,78%
201	297	2.638.455.038,83	1,789712	14,80%	15,20%	97,38%
201	174	1.520.412.873,64	1,558978	23,26%	23,37%	99,52%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Títulos Federais	79,76%
	Operação compromissada	20,22%
	Valores a pagar/receber	0,02%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	25,4
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo investe em títulos públicos federais pré-fixados. Mantém um prazo médio de carteira entre um a três anos.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: 18/03/2021 CPF	Assinatura
Mariana Vieira dos Santos Mariano Mendes de Sousa	Diretoria administrativa	060209763.00	
Planejar	Gestor de Recursos	048086.153 63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	10.577.519/0001-90
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	25/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	05/12/2008	Data de Início das Atividades:	11/05/2012
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IRF-M 1+	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré e/ou pós-fixadas.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	375	2.814.559.159,07	2,589171	8,22%	8,45%	97,18%
2019	314	2.077.044.204,00	2,392607	13,89%	14,24%	97,54%
201	210	1.727.220.474,01	2,100832	12,30%	12,27%	100,29%
201	189	1.369.000.972,62	1,870695	16,15%	16,67%	96,86%
201	117	398.216.901,24	1,610594	29,55%	29,64%	99,71%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Títulos Federais	93,43%
	Operação compromissada	6,56%
	Valores a pagar/receber	0,01%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	29,6
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo investe em títulos públicos federais, pré-fixados que tenham prazo de vencimento superior a um ano. É um fundo extremamente volátil, mais indicado para investidores agressivos.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Vleide dos Santos Barbosa Gordiano de Sousa Leonar	Diretora administrativa Gestor de recursos	060.209.763-00 048.086.153-63	Vleide Gordiano

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	05.164.356/0001-84
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	30/09/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	01/04/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	16/07/2002	Data de Início das Atividades:	10/02/2006
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	CDI	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais, com prazo médio de carteira superior 365 dias.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		

Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado
	Prazo de carência	Não há
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há
	Taxa de saida	Não há
	Taxa de administração	0,20%

Taxa de Performance		
Índice de referencia	*Frequência*	Linha-d água
Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	412	3.745.587.728,16	4,049998	2,46%	2,76%	89,07%
2019	376	3.186.970.307,05	3,952897	5,91%	5,96%	99,22%
201	425	2.386.354.167,00	3,732199	6,18%	6,42%	96,18%
201	424	1.786.324.170,02	3,515095	9,91%	9,93%	99,87%
201	442	1.865.446.621,60	3,198077	14,04%	14,00%	100,27%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Operação compromissada	64,52%
	Títulos Federais	35,48%
	Valores a pagar/receber	0,00%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	17,1
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo investe em títulos públicos federais, em sua maioria em LFTs (Títulos públicos pós-fixados), que acompanham a Selic. Por conta disto, é considerado um fundo extremamente conservador.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Vilenda dos Santos Nascimento	Diretora Administrativa	060205763-00	Vilenda
Yordas de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	Yordas

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância dos 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	14.508.643/0001-55
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	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
X	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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	13/10/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	13/09/2011	Data de Início das Atividades:	30/08/2012
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	CDI	
	Aplica seus recursos, preponderantemente, em cotas de fundos de investimentos que apliquem exclusivamente em títulos públicos federais.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,80%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	297	910.358.895,05	1,881606	1,89%	2,76%	68,58%
2019	324	454.779.429,74	1,846501	5,07%	5,96%	85,00%
201	307	658.051.553,40	1,757341	5,54%	6,42%	86,35%
201	235	447.901.791,70	1,664991	9,02%	9,93%	90,90%
201	190	276.426.644,27	1,526834	13,05%	14,00%	93,23%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Fundos de Investimento	100,01%
	Valores a pagar/receber	-0,01%

		CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.	04.150.666/0001-87	Art. 7º, IV, "a"	100,01%
	2.			
	3.			
	4.			
	5.			

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	0,0
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo investe em títulos públicos federais, pós-fixados e de curto prazo. Este fundo tem a função de aplicações e resgates automáticos, o que o torna muito útil para o fluxo de caixa do RPPS. Ele é considerado um fundo extremamente conservador.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Zayra Vilela dos Santos Zaperuko	Diretora administrativa	060209763-00	
Yordas de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	11.061.217/0001-28
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	14/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	02/04/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	30/07/2009	Data de Início das Atividades:	08/07/2010
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA GERAL	
	Investe seus recursos em títulos públicos federais em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o Índice IMA Geral.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	*Frequência*	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	224	1.195.459.257,45	2,979659	4,82%	5,34%	90,31%
2019	229	1.431.995.533,36	2,842656	12,33%	12,82%	96,16%
201	171	1.121.031.482,25	2,530649	9,63%	10,03%	96,01%
201	193	1.207.839.514,66	2,308256	12,59%	12,82%	98,19%
201	198	1.147.937.052,01	2,050218	20,94%	21,00%	99,76%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	85,56%
	Operação compromissada	14,44%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	44,4
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo é referenciado no índice IMA GERAL, ou seja, busca replicar a carteira e o desempenho deste benchmark.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Aleide dos Santos Nascimento	Diretora administrativa	060209763-00	
Jordas de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância dos 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	23.215.008/0001-70
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	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
X	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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	14/06/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	18/08/2015	Data de Início das Atividades:	17/12/2015
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	CDI	
	Aplica seus recursos em carteira de ativos financeiros indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas e/ou índices de preços.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	52	1.133.205.869,81	1,452710	2,67%	2,76%	96,67%
2019	66	1.108.750.074,25	1,414985	5,87%	5,96%	98,50%
201	58	187.598.156,96	1,336522	6,25%	6,42%	97,36%
201	34	99.298.245,34	1,257883	9,96%	9,93%	100,32%
201	26	88.503.109,51	1,143971	13,87%	14,00%	99,06%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	36,04%
	Títulos Privados	34,74%
	Operação compromissada	27,37%
	Debêntures	1,85%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	60.746.948/0001-12	Instituição Financeira	10,16%
	60.701.190/0001-04	Instituição Financeira	5,30%
	15.114.366/0001-69	Instituição Financeira	2,95%
	28.195.667/0001-06	Instituição Financeira	2,41%
	14.388.334/0001-99	Instituição Financeira	2,14%

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)	23,2
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo investe em títulos públicos federais, atualmente tem alta exposição em títulos pré-fixados e pós-fixados, de curto prazo. Por conta disto, é considerado um fundo extremamente conservador.

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
Marina Aleide dos Santos Marinho	Diretora administrativa	060209763.00	
Jordana de Sousa Menezes	Gestor de recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP			CNPJ FUNDO	03.737.206/0001-97
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	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
X	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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	06/05/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	29/02/2000	Data de Início das Atividades:	05/07/2006
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	CDI	
	Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito e classificados por agência de risco registrada na CVM.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	641	4.230.515.183,84	3,739417	2,42%	2,76%	87,59%
2019	688	4.527.790.510,67	3,651222	5,72%	5,96%	95,89%
201	827	6.777.682.965,68	3,453828	6,23%	6,42%	97,03%
201	748	5.699.053.539,88	3,251258	9,94%	9,93%	100,15%
201	758	5.994.853.429,68	2,957304	14,00%	14,00%	99,97%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	50,18%
	Títulos Privados	36,21%
	Operação compromissada	10,72%
	Debêntures	2,89%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	60.746.948/0001-12	Instituição Financeira	11,29%
	59.588.111/0001-03	Instituição Financeira	5,36%
	60.701.190/0001-04	Instituição Financeira	3,39%
	07.237.373/0001-20	Instituição Financeira	2,30%
	30.306.294/0001-45	Instituição Financeira	1,90%

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)	23,6
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo investe em títulos públicos federais, pós-fixados e de curto prazo. Por conta disto, é considerado um fundo extremamente conservador.

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
Maria Vleide dos Santos Marinho	Diretora administrativo.	060209763-00	
Gerson Cordeiro de Sousa	Gestor de recursos	048086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP			CNPJ FUNDO	10.646.895/0001-90
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	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"
X	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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	02/08/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	02/04/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	28/01/2009	Data de Início das Atividades:	27/10/2009
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		

Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado
	Prazo de carência	Não há
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há
	Taxa de saída	Não há
	Taxa de administração	0,20%
	Taxa de Performance	

Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	301	2.989.829.287,39	3,933790	6,05%	6,41%	94,46%
2019	305	3.047.753.091,50	3,709357	22,46%	22,95%	97,88%
201	265	1.982.330.259,99	3,028916	12,94%	13,06%	99,08%
201	313	2.480.853.390,51	2,681919	12,36%	12,79%	96,60%
201	326	2.286.107.718,62	2,386920	24,14%	24,81%	97,29%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Fundos de Investimento	100,00%
	Valores a pagar/receber	0,00%

		CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.	10.740.739/0001-93	Art. 7º, III, "a"	100,00%
	2.			
	3.			
	4.			
	5.			

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	12,2
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	Fundo é referenciado IMA-B, ou seja, busca replicar o desempenho deste benchmark, então investe integralmente em títulos públicos federais atrelados a inflação (NTN-B).

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
Maria Vilenilde dos Santos Marinho	Diretora administrativa.	060209763-00	Vilenilde
Yondas de Sousa Menezes	Gestor de recursos	048.086.153-63	Yondas

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância dos 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			CNPJ FUNDO	05.164.364/0001-20
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	25/10/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	01/04/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	16/07/2002	Data de Início das Atividades:	18/07/2005
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	CDI	
	Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas (SELIC/CDI).		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	75	206.724.382,88	4,502085	2,64%	2,76%	95,90%
2019	86	140.059.639,22	4,386086	5,87%	5,96%	98,49%
201	125	315.001.616,00	4,142900	6,13%	6,42%	95,51%
201	123	277.680.574,91	3,903487	9,84%	9,93%	99,11%
201	133	269.190.533,14	3,553878	14,04%	14,00%	100,29%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Operação compromissada	55,89%
	Títulos Federais	44,11%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	15,4
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo investe em títulos públicos federais, atualmente tem alta exposição em títulos públicos pré-fixados e pós fixados de curto prazo. Por conta disto, é considerado um fundo extremamente conservador.

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
Maria Vilende dos Santos Marinho Gonçalves de Sousa Vilenea	Diretora administrativa. Gestor de Recursos	060209763.00 048.086.153 63	Vilende Gonçalves

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	18.598.117/0001-84
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	N/A	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das Informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	26/06/2013	Data de Início das Atividades:	21/02/2014
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IPCA+6%	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	16/08/2022	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	17	86.344.692,42	1,486848	4,78%	10,76%	44,45%
2019	17	82.402.656,12	1,418967	4,08%	10,59%	38,51%
201	17	79.173.440,77	1,363360	4,14%	9,92%	41,72%
201	17	76.027.008,37	1,309179	2,85%	9,05%	31,46%
201	17	73.922.760,76	1,272944	6,76%	12,64%	53,52%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,83%
	Operação compromissada	0,17%
	Valores a pagar/receber	0,01%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	19,5
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, prometendo rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração deste fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2022.

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
Maria Neide dos Santos Nascimento	Diretora administrativa	060.109.763-00	
Yordas de Sousa Silencar	Gestor de recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	18.598.288/0001-03
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	26/06/2013	Data de Início das Atividades:	30/01/2014
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós fixadas e/ou índices de preços.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		

Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado
	Prazo de carência	16/08/2024
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há
	Taxa de saída	Não há
	Taxa de administração	0,20%
	Taxa de Performance	
	Índice de referencia	Frequência / Linha-d água
	Não possui	Não se aplica / Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	104	470.598.208,00	1,760894	3,81%	6,41%	59,52%
2019	104	453.314.125,00	1,696220	11,75%	22,95%	51,20%
201	104	405.648.494,83	1,517864	6,00%	13,06%	45,95%
201	104	382.683.157,31	1,431932	7,42%	12,79%	58,00%
201	104	356.247.868,17	1,333016	16,46%	24,81%	66,36%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento		
Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Títulos Federais	99,83%
	Operação compromissada	0,17%
	Valores a pagar/receber	0,00%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	39,8
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2024.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Neide dos Santos Marinho	Diretora administrativa	060209763-00	Neide
Yandara de Sousa Menezes	Gestor de recursos	048.086.153-63	Yandara

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância dos 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	18.598.088/0001-50
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	N/A	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	26/06/2013	Data de Início das Atividades:	25/02/2014
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IPCA+6%	
	Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós- fixadas e/ou índices de preços. Não realiza operações de day-trade.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	15/08/2024	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	38	200.132.105,82	1,487721	4,81%	10,76%	44,65%
2019	38	190.956.025,88	1,419509	4,10%	10,59%	38,76%
201	38	183.427.955,73	1,363547	4,18%	9,92%	42,11%
201	38	176.072.589,49	1,308870	2,82%	9,05%	31,18%
2	38	171.240.588,69	1,272950	6,84%	12,64%	54,12%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,84%
	Operação compromissada	0,16%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	43,5
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2024.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Maria Aleide dos Santos Marinho	Diretora Administrativa	060209763.00	
Yordan de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	19.769.135/0001-44
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	23/01/2014	Data de Início das Atividades:	21/03/2014
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós- fixadas e/ou índices de preços. Não realiza operações de day-trade.		
Público-alvo do Fundo:	**Exclusivo previdenciário**		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	**Indeterminado**	
	Prazo de carência	**15/08/2024**	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	**D+0 dias úteis**	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	**D+0 dias úteis**	
	Prazo Total (dias)	**0 dias úteis**	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	**Não há**	
	Taxa de saída	**Não há**	
	Taxa de administração	**0,20%**	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	**Não se aplica**	**Não se aplica**

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	21	53.079.752,80	1,746535	3,84%	6,41%	59,96%
2019	21	51.116.626,84	1,681940	11,72%	22,95%	51,08%
201	21	45.752.638,68	1,505444	5,98%	13,06%	45,82%
201	21	43.169.603,24	1,420452	7,43%	12,79%	58,06%
201	21	40.184.582,65	1,322233	16,45%	24,81%	66,29%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,80%
	Operação compromissada	0,19%
	Valores a pagar/receber	0,01%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	39,8
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2024.

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
Responsável pela Análise	Cargo	CPF	Assinatura
Maria Vilenilde dos Santos Barreiros Gonçalves de Sousa Menezes	Diretora administrativa. Gestor de recursos	060209763-00 048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	20.139.595/0001-78
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	01/04/2014	Data de Início das Atividades:	09/03/2015
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2024.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	15/08/2024	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saida	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	*Frequência*	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	74	1.463.442.575,00	1,589622	3,78%	6,41%	59,05%
2019	74	1.410.103.021,71	1,531684	11,77%	22,95%	51,29%
201	73	1.261.598.283,87	1,370375	6,10%	13,06%	46,75%
201	72	988.925.886,22	1,291531	7,37%	12,79%	57,61%
201	72	820.476.215,39	1,202876	15,84%	24,81%	63,83%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,85%
	Operação compromissada	0,15%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	39,8
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2024.

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
Maria Vilde dos Santos Marinho	Diretora administrativa	060209763-00	Vilde
Jordas de Sousa Menor	Gestor de Recursos	048.086.153-63	Jordas

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	19.768.682/0001-05
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	23/01/2014	Data de Início das Atividades:	25/03/2015
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	15/08/2024	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	26	181.980.613,74	1,575003	3,82%	6,41%	59,60%
2019	26	175.288.806,92	1,517087	11,75%	22,95%	51,18%
201	26	156.864.693,88	1,357630	6,00%	13,06%	45,96%
201	26	147.982.814,25	1,280760	7,42%	12,79%	58,01%
201	26	137.758.057,98	1,192267	16,45%	24,81%	66,31%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,83%
	Operação compromissada	0,17%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	39,8
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2024.

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
Maria Glenda dos Santos Marinho	Diretora Administrativa	060209763.00	
Yandara de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	22.791.074/0001-26
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	08/06/2015	Data de Início das Atividades:	19/08/2015
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Alocando exclusivamente em NTB-B com vencimento em 2024.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	16/08/2024	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saida	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	17	223.356.568,60	1,582263	3,81%	6,41%	59,45%
2019	17	215.163.330,31	1,524222	11,76%	22,95%	51,23%
201	17	192.527.660,03	1,363870	6,01%	13,06%	46,00%
201	17	181.617.765,06	1,286585	7,42%	12,79%	57,98%
201	17	169.076.380,10	1,197741	16,37%	24,81%	65,99%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,83%
	Operação compromissada	0,17%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	39,8
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2024.

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
Maria Vleide de S	Diretora	060209763-00	Vleide
Santos Barreiros	administra-		
Jordão de Sousa	tivo.		
Heneas	Gestor de	048.086.153	Jordão
	Recursos	63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	18.598.042/0001-31
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	N/A	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	31/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	26/06/2013	Data de Início das Atividades:	27/02/2014
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IPCA+6%	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		

Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado
	Prazo de carência	16/08/2030
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há
	Taxa de saida	Não há
	Taxa de administração	0,20%

Taxa de Performance		
Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	34	226.694.043,79	1,481842	4,74%	10,76%	44,00%
2019	34	216.443.416,56	1,414836	4,07%	10,59%	38,42%
201	34	207.982.175,01	1,359527	4,13%	9,92%	41,59%
201	34	199.741.830,06	1,305662	2,67%	9,05%	29,54%
201	34	194.542.444,85	1,271675	6,84%	12,64%	54,13%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,85%
	Operação compromissada	0,15%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	115,5
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2030.

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
Maria Vilenilde dos Santos Marinho	Diretora Administrativa	060209763.00	
Yordan de Sousa Menezes	Gestor de Recursos	048.086.153-63	

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	19.769.046/0001-06
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de Informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	23/01/2014	Data de Início das Atividades:	26/03/2014
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	15/08/2030	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saida	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	18	71.349.252,27	1,938139	4,75%	6,41%	74,14%
2019	18	68.114.289,84	1,850265	17,61%	22,95%	76,71%
2018	18	57.917.780,87	1,573285	7,87%	13,06%	60,24%
2017	18	53.693.780,62	1,458544	6,48%	12,79%	50,68%
2016	18	50.424.255,65	1,369730	22,92%	24,81%	92,37%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,82%
	Operação compromissada	0,17%
	Valores a pagar/receber	0,01%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	92,5
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2030.

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
Maria Glenda dos Santos Marinho Jordão de Sousa Menezes	Diretora administrativa. Gestor de recursos	060 209 763 00 048.086.153 63	Jordão

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[1]

(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)

[1] Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, 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 Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA			CNPJ FUNDO	20.139.534/0001-00
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento		CNPJ GES	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010

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 ANBIMA de *due diligence* para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	28/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
3. Lâmina de Informações essenciais	08/01/2021	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre
4. Formulário de informações complementares	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
5. Perfil Mensal	08/01/2021	https://www.caixa.gov.br/fundos-
6. Demonstração de Desempenho	28/08/2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-
7. Relatórios de Rating	N/A	https://www.caixa.gov.br/fundos-
8. Demonstrações Contábeis	30/03/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosre

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	01/04/2014	Data de Início das Atividades:	16/03/2015
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	IMA-B	
	Aplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2030.		
Público-alvo do Fundo:	Exclusivo previdenciário		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	15/08/2030	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+0 dias úteis	
	Prazo Total (dias)	0 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	0,20%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	*Frequência*	Linha-d água
	Não possui	Não se aplica	Não se aplica

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:	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:	Aderente
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO ; RISCO DE SISTÊMICO ; RISCO DE CREDITO (Vide Regulamento)

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (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	27	383.439.882,64	1,736935	4,74%	6,41%	73,94%
2019	27	366.100.921,96	1,658392	17,60%	22,95%	76,70%
201	27	311.301.647,07	1,410158	7,85%	13,06%	60,15%
201	26	248.056.022,68	1,307458	6,29%	12,79%	49,15%
201	26	209.356.623,51	1,230109	22,24%	24,81%	89,65%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

	Espécie de ativos	% do PL
Composição da carteira (atual)	Títulos Federais	99,84%
	Operação compromissada	0,16%
	Valores a pagar/receber	0,00%

	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	1.		
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL do Fundo
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)	92,5
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Compatível

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo tem desempenho compatível com o seu benchmark
Comentários Adicionais	O fundo é fechado e investe em um único título público federal, com o intuito de rentabilizar ao RPPS a meta atuarial do período de duração do fundo. Os recursos investidos neste fundo só poderão ser resgatados em 2030.

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.

Responsáveis pela Análise:	Cargo	Data: CPF	18/03/2021 Assinatura
Marcus Vinicius dos Santos Nogueira	Diretoria administrativa	060209763-00	
Jordana de Souza Moncorvo	Gestor de Recursos	048086.153-63	

01

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
18.598.117/0001-84				
1.3	Data de início			
21/02/2014				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Não classificado				
1.6	Código ANBIMA			
360783				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Sim				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001906.3				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		16/08/2022		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		1.000.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível com a variação do IPCA + 6% a.a.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.
O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.	
2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.
Revista Exame 2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos Ranking ANBIMA 2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração Revista Investidor Institucional 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais" TOP ASSET Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS Rating Fitch Rating – "Forte" Ranking ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)	
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo	
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).
SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Melchior Vinícius dos Santos Felix GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Carlos Eduardo Bitell	
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinícius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)	
2.3 - Estratégias e Carteiras	
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
Brasil (exclusivamente)	[X]
Brasil (predominantemente) especifique:	N/A
Global especifique:	N/A
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	
2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	
2.3.6.1	de fundos de terceiros? (S/N): -
2.3.6.2	de fundos do gestor? (S/N): -
3 - Informações Adicionais	
3.1	PL atual
82.402.556,12	
3.2	PL médio em 12 meses
80.284.083,66	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
9.486.754.949,49	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
17	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
64,72% e 87,94%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 334.118
VaR	6 meses 277.062
VaR	12 meses 251.714
VaR	24 meses 291.862
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -5,152,884
Stress	6 meses -5,067,904
Stress	12 meses -5,387,934
Stress	24 meses -5,348,237
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

02

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
20.139.534/0001-00				
1.3	Data de início			
16/03/2015				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
390313				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1929-2				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		15/08/2030		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300,000.00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2030.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
366.100.921,96	
3.2	PL médio em 12 meses
344.415.190,90	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
27			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
67,68% e 88,37%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.470.686	
VaR	6 meses	1.452.302	
VaR	12 meses	1.441.481	
VaR	24 meses	1.462.731	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-50.388.325	
Stress	6 meses	-58.386.781	
Stress	12 meses	-54.826.878	
Stress	24 meses	-47.873.268	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES				
1.2	CNPJ			
30.068.224/0001-04				
1.3	Data de início			
25/08/2010				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Livre				
1.6	Código ANBIMA			
500909				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,2069-0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
30791,00-4				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	13:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+23 du	D+25 du	13:00
Aplicação inicial mínima		50.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		1.000,00		
Resgate Mínimo		1.000,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade superior à variação do Ibovespa.Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de ações geridos por gestores distintos.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2015 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		N/A
Brasil (predominantemente)	especifique:	[X] *O fundo permite até 20% do seu PL em ativos financeiros negociados no exterior, diretamente ou por meio dos fundos investidos, observadas as regras e condições previstas na legislação vigente*
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
Cotas de fundos que invistam até 20% do seu PL em ativos no exterior.	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	S
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
518,790,442.59	
3.2	PL médio em 12 meses

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.673.697.615,26			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
2.570			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
10,49% e 16,4%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	4.662.486	
VaR	6 meses	4.071.260	
VaR	12 meses	3.981.191	
VaR	24 meses	3.981.191	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-19.585.255	
Stress	6 meses	-12.688.540	
Stress	12 meses	-12.404.601	
Stress	24 meses	-12.404.601	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
Risco proveniente de mercado externo (vide Regulamento).	
10.3	Qual o produto?
Apenas indiretamente, através de cotas de fundos.	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
Apenas indiretamente, através de cotas de fundos.	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
Apenas indiretamente, através de cotas de fundos.	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

04

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
05.164.358/0001-73				
1.3	Data de início			
01/11/2005				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
157252				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000113.0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Investe em carteira composta por títulos de emissão do Tesouro Nacional e/ou do Banco Central do Brasil em operações finais e/ou compromissadas, lastreadas em títulos públicos federais.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinícius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
260.996.575,85	
3.2	PL médio em 12 meses
295.931.623,64	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
94			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
48,29% e 63,25%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	61,881	
VaR	6 meses	40,627	
VaR	12 meses	30,396	
VaR	24 meses	25,745	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-6,202,789	
Stress	6 meses	-6,125,420	
Stress	12 meses	-5,228,270	
Stress	24 meses	-4,150,579	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP				
1.2	CNPJ			
08.070.841/0001-87				
1.3	Data de início			
01/02/2007				
1.4	Classificação CVM			
Multimercado				
1.5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Macro				
1.6	Código ANBIMA			
276121				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo Prazo				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
0238,050,00001757,5				
1.13	Conta CETIP (nº)			
03444,00-3				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	16:00
Aplicação inicial mínima		50,000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
2,00%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Buscar rentabilidade que supere a variação do CDI.Aplica em fundos que invistam em carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, nacional e internacional, com prazo médio superior a 365 dias.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		N/A
Brasil (predominantemente)	especifique:	[X] *O fundo permite até 20% do seu PL em ativos financeiros negociados no exterior, diretamente ou por meio dos* fundos investidos, observadas as regras e condições previstas na legislação vigente
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
Cotas de fundos que investam até 20% do seu PL em ativos no exterior.	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Permitido.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Sim
Ações	Sim
Commodities	Sim
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
6.549.214.461,54	
3.2	PL médio em 12 meses
2.095.426.714,58	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
6.549.214.461,54			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
26.794			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
3,47% e 5,17%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicos do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	33.643.054	
VaR	6 meses	20.634.845	
VaR	12 meses	12.251.692	
VaR	24 meses	7.031.913	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-793.448.644	
Stress	6 meses	-516.169.880	
Stress	12 meses	-309.423.984	
Stress	24 meses	-174.183.212	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da capacity (capacidade de alocação da estratégia) por parte do Gestor.	
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	
9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	
10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
Risco proveniente de mercado externo (vide Regulamento).	
10.3	Qual o produto?
Apenas indiretamente, através de cotas de fundos.	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
Apenas indiretamente, através de cotas de fundos.	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
Apenas indiretamente, através de cotas de fundos.	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
19.769.171/0001-08				
1.3	Data de início			
19/03/2014				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
363200				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001909.8				
1.13	Conta CETIP (nº)			
22932.00-8				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		17/08/2020		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Busca acompanhar IMA-B.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.
O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.	

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.
Revista Exame 2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos Ranking ANBIMA 2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração Revista Investidor Institucional 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2018 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais" TOP ASSET Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS Rating Fitch Rating – "Forte" Ranking ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)	

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).
SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Melchior Vinicius dos Santos Felix GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Carlos Eduardo Bitell	

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)	

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	
Proteção de carteira ou de posição	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos: Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
69.051.706,62	
3.2	PL médio em 12 meses
67.673.573,62	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
20			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
73,9% e 89,88%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	84.402	
VaR	6 meses	67.380	
VaR	12 meses	65.458	
VaR	24 meses	101.236	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-239.537	
Stress	6 meses	-250.513	
Stress	12 meses	-713.641	
Stress	24 meses	-1.156.281	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.		
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores		
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?	
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.		
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?	
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.		
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?	
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.		
9 – Atendimento aos Cotistas		
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?	
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.		
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?	
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.		
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?	
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.		
10 - Investimento no Exterior		
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo		
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?	
N/A		
10.2	Quais os riscos envolvidos?	
N/A		
10.3	Qual o produto?	
N/A		
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?	
N/A		
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?	
N/A		
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)	
N/A		
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.	
N/A		
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?	
N/A		
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.	
N/A		

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP				
1.2	CNPJ			
30.036.235/0001-02				
1.3	Data de início			
16/10/2018				
1.4	Classificação CVM			
Multimercado				
1.5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Livre				
1.6	Código ANBIMA			
476692				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo Prazo				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
0238-050-2057-6				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+1 du	16:00
Aplicação inicial mínima		10.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		1.000,00		
Resgate Mínimo		1.000,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplica seus recursos nos mercados de renda fixa e renda variável, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial, se utilizando de operações de derivativos de contrato futuro de S&P500 para hegde e posicionamento.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		N/A
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	[X] O fundo realizará operações de derivativos envolvendo, preponderantemente, mas não limitadamente, contratos

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
Contratos futuros de S&P500.	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
280,875,650,31	
3.2	PL médio em 12 meses
69,382,155,99	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
26.149.650.392,15			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
4.020			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
5,93% e 9,95%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	6.694	
VaR	6 meses	6.115	
VaR	12 meses	4.193	
VaR	24 meses	3.715	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-2.207.292	
Stress	6 meses	-1.393.672	
Stress	12 meses	-884.602	
Stress	24 meses	-775.328	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conferenca calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
Risco de Mercado Externo (vide Regulamento).	
10.3	Qual o produto?
S&P500	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
Operações de derivativos envolvendo, preponderantemente, mas não limitadamente, contratos futuros de S&P500.	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
Derivativos que envolvam contratos futuros de S&P500.	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal de carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
18.598.154/0001-92				
1.3	Data de início			
19/02/2014				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Não classificado				
1.6	Código ANBIMA			
360503				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Sim				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001905-5				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		18/08/2020		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		1.000.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível com a variação do IPCA + 6% a.a.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
140,517,673,48	
3.2	PL médio em 12 meses
136,840,777,82	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
9.486.754.949,49			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
19			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
77% e 90%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	158.352	
VaR	6 meses	126.417	
VaR	12 meses	122.807	
VaR	24 meses	189.919	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-449,413	
Stress	6 meses	-470,006	
Stress	12 meses	-1.338,823	
Stress	24 meses	-2.159,154	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim	Não	
11.2	Prospecto	Sim	Não	
11.3	Última lâmina	Sim	Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim	Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim	Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim	Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
20.139.342/0001-02				
1.3	Data de início			
01/04/2015				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
391840				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1935-7				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		15/08/2020		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Busca acompanhar o IMA-B.Aplica seus recursos em NTN-B com vencimento em 2020.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
129.569.346,13	
3.2	PL médio em 12 meses
126.976.830,15	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
21			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
67,14% e 91,24%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	178,406	
VaR	6 meses	142,426	
VaR	12 meses	138,326	
VaR	24 meses	215,102	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-506,325	
Stress	6 meses	-529,526	
Stress	12 meses	-1.507,569	
Stress	24 meses	-2.447,865	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
21.919.953/0001-28				
1.3	Data de início			
28/07/2015				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
400671				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1942-0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
23074,00-6				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		16/08/2020		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Proporcionar ao cotista a valorização de suas cotas.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Alocando exclusivamente em NTB-B com vencimento em 2020.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitelí

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
1.020.069.053,27	
3.2	PL médio em 12 meses
999.525.261,09	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
107			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
52,19% e 67,13%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.246.654	
VaR	6 meses	995.236	
VaR	12 meses	966.787	
VaR	24 meses	1.495.030	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-3.538.078	
Stress	6 meses	-3.700.197	
Stress	12 meses	-10.539.281	
Stress	24 meses	-17.075.168	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1,1	Nome			
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1,2	CNPJ			
18.598.288/0001-03				
1,3	Data de início			
30/01/2014				
1,4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1,5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1,6	Código ANBIMA			
359947				
1,7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1,8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1,9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1,10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1,11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1,12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001903,9				
1,13	Conta CETIP (nº)			
22929,00-4				
1,14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1,17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1,18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1,19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		16/08/2024		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1,20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1,21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1,22	Taxa de Administração			
0,20%				
1,23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1,24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1,25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1,26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1,27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2,1 – Perfil				
2,1,1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Busca acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B.Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós fixadas e/ou índices de preços.				
2,1,2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2,1,3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
453.314.125,00	
3.2	PL médio em 12 meses
429.740.815,70	

3,3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3,4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3,5	Número de cotistas		
104			
3,6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3,7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3,8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
33,67% e 49,52%			
3,9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3,10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3,11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4,1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4,2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4,3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4,4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4,5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4,6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4,7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4,8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4,9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4,10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4,11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	243,676	
VaR	6 meses	220,426	
VaR	12 meses	199,872	
VaR	24 meses	214,379	
4,12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4,13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4,14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4,15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-5,352,428	
Stress	6 meses	-5,209,651	
Stress	12 meses	-5,153,752	
Stress	24 meses	-4,787,308	
4,16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
18.598.088/0001-50				
1.3	Data de início			
25/02/2014				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Não classificado				
1.6	Código ANBIMA			
360821				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Sim				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001907,1				
1.13	Conta CETIP (nº)			
20867,00-3				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		15/08/2024		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		1.000.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível com a variação do IPCA + 6%.Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós- fixadas e/ou índices de preços. Não realiza operações de day-trade.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
190.958.025,88	
3.2	PL médio em 12 meses
186.016.239,23	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
9.486.754.949,49			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
38			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
46,61% e 67,8%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.068.226	
VaR	6 meses	966.303	
VaR	12 meses	876.000	
VaR	24 meses	942.513	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-23.507.806	
Stress	6 meses	-22.838.058	
Stress	12 meses	-22.586.556	
Stress	24 meses	-21.008.693	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	
9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	
10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
19.769.135/0001-44				
1.3	Data de início			
21/03/2014				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
363456				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050.00001911,0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		15/08/2024		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Busca acompanhar o IMA-B.Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós- fixadas e/ou índices de preços. Não realiza operações de day-trade.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	
Proteção de carteira ou de posição	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Mudança de remuneração/indexador	Vedado.
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não cita
2.3.5.2	Não
Juros	Mercados em que são utilizados derivativos:
Câmbio	Sim
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	Não
· Com garantia	
· Sem garantia	Sim
Em balcão:	Não
· Com garantia	
· Sem garantia	Sim
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	Não
2.3.6.1	
2.3.6.2	de fundos de terceiros? (S/N): -
	de fundos do gestor? (S/N): -

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
51.116.626,84	
3.2	PL médio em 12 meses
48.461.317,10	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
21			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
64,2% e 84,87%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	2.160.942	
VaR	6 meses	1.954.759	
VaR	12 meses	1.772.379	
VaR	24 meses	1.900.799	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-47.554.539	
Stress	6 meses	-46.199.690	
Stress	12 meses	-45.700.470	
Stress	24 meses	-42.447.191	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
N/A	Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
20.139.595/0001-78				
1.3	Data de início			
09/03/2015				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
390054				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1926-8				
1.13	Conta CETIP (nº)			
21637.00-5				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		15/08/2024		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2024.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	
2.3.5 – Uso de Derivativos	

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
1.410.103.021,71	
3.2	PL médio em 12 meses
1.339.000.863,29	

3,3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3,4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3,5	Número de cotistas		
74			
3,6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3,7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3,8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
56,52% e 71,3%			
3,9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3,10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3,11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4,1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4,2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4,3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4,4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4,5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4,6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4,7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4,8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4,9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4,10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4,11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	6.721.641	
VaR	6 meses	6.080.307	
VaR	12 meses	5.512.086	
VaR	24 meses	5.602.404	
4,12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4,13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4,14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4,15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-147.919.073	
Stress	6 meses	-143.704.796	
Stress	12 meses	-142.122.259	
Stress	24 meses	-125.702.061	
4,16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1,1	Nome			
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1,2	CNPJ			
19,768,582/0001-05				
1,3	Data de início			
25/03/2015				
1,4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1,5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1,6	Código ANBIMA			
390402				
1,7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1,8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1,9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1,10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1,11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1,12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1928-4				
1,13	Conta CETIP (nº)			
22935,00-5				
1,14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1,17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1,18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1,19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		15/08/2024		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300,000.00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1,20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1,21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1,22	Taxa de Administração			
0,20%				
1,23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1,24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1,25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1,26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1,27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2,1 – Perfil				
2,1,1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Busca acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B.Aplica seus recursos em títulos públicos federais.				
2,1,2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2,1,3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
175.288.806,92	
3.2	PL médio em 12 meses
166.181.302,44	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou de eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
26			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
65,77% e 83,51%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.025.679	
VaR	6 meses	927.816	
VaR	12 meses	841.238	
VaR	24 meses	902.168	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress* ?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-22.571.496	
Stress	6 meses	-21.928.424	
Stress	12 meses	-21.591.082	
Stress	24 meses	-20.146.562	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	
9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	
10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1,1	Nome			
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1,2	CNPJ			
22,781,074/0001-26				
1,3	Data de Início			
19/08/2015				
1,4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1,5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1,6	Código ANBIMA			
401862				
1,7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1,8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1,9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1,10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1,11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1,12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1953-5				
1,13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1,14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1,17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1,18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1,19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		16/08/2024		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		300,000.00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1,20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1,21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1,22	Taxa de Administração			
0,20%				
1,23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1,24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1,25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1,26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1,27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Acompanhar o IMA-B.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Alocando exclusivamente em NTB-B com vencimento em 2024.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
215.163.330,31	
3.2	PL médio em 12 meses
203.971.089,95	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
17			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
79,53% e 96,53%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	835.658	
VaR	6 meses	755.925	
VaR	12 meses	685.397	
VaR	24 meses	734.299	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-18.389.827	
Stress	6 meses	-17.865.893	
Stress	12 meses	-17.672.828	
Stress	24 meses	-16.411.906	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises			
Período	Evento	Comportamento	Explicação
Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
ago/98	Crise da Rússia	N/A	
out/98	Quebra do LTCM	N/A	
jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
abr/01	Apagão	N/A	
set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
jun/02	Marcação a mercado	N/A	
Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)				
Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1. N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.				
3.				

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
	Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
18.598.042/0001-31				
1.3	Data de início			
27/02/2014				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Não classificado				
1.6	Código ANBIMA			
360791				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Sim				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001908.0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		16/08/2030		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		1.000.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível com a variação do IPCA + 6% a.a.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinícius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinícius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
216.443.416,56	
3.2	PL médio em 12 meses
210.854.770,69	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
9.486.754.949,49			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
34			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
54,26% e 76,49%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.923.125	
VaR	6 meses	1.899.086	
VaR	12 meses	1.885.352	
VaR	24 meses	1.864.108	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-78.966.072	
Stress	6 meses	-76.348.777	
Stress	12 meses	-71.710.097	
Stress	24 meses	-61.009.085	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.	
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	
9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	
10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
19.769.046/0001-06				
1.3	Data de início			
26/03/2014				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
363741				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001912-8				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		15/08/2030		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	15:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Busca acompanhar o IMA-B.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento

2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
68.114.289,84	
3.2	PL médio em 12 meses
64.079.094,03	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
18			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
71,17% e 90,19%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	357.781	
VaR	6 meses	353.309	
VaR	12 meses	350.755	
VaR	24 meses	356.081	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-14.590.962	
Stress	6 meses	-14.204.037	
Stress	12 meses	-13.341.107	
Stress	24 meses	-11.652.258	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicicade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1,1	Nome			
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES				
1,2	CNPJ			
30.068.169/0001-44				
1,3	Data de início			
31/07/2019				
1,4	Classificação CVM			
Ações				
1,5	Classificação ANBIMA			
Ações Livre				
1,6	Código ANBIMA			
503452				
1,7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1,8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1,9	Público-alvo			
Investidores institucionais				
1,10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1,11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1,12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,2077-0				
1,13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1,14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1,17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1,18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1,19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+13 du	D+15 du	17:00
Aplicação inicial mínima		50.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		25.000,00		
Resgate Mínimo		25.000,00		
1,20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1,21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1,22	Taxa de Administração			
2,00%				
1,23	Taxa de Administração máxima			
2,00%				
1,24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1,25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1,26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1,27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2,1 – Perfil				
2,1,1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em ações, negociados nos mercados interno e/ou externo, com o compromisso de concentração nessa classe específica.				
2,1,2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2,1,3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	
Proteção de carteira ou de posição	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Mudança de remuneração/indexador	Sim
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não cita
2.3.5.2	Não
Juros	Mercados em que são utilizados derivativos:
Câmbio	Sim
Ações	Não
Commodities	Sim
Em Bolsas:	Não
· Com garantia	
· Sem garantia	Sim
Em balcão:	Não
· Com garantia	
· Sem garantia	Sim
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	Não

2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
116,430,676,78	
3.2	PL médio em 12 meses

3,3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.673.697.515,26			
3,4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3,5	Número de cotistas		
43			
3,6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3,7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3,8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
62,72% e 76,8%			
3,9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3,10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3,11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4,1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4,2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4,3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4,4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4,5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4,6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4,7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4,8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4,9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4,10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4,11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.066.365	
VaR	6 meses	902.435	
VaR	12 meses	902.435	
VaR	24 meses	902.435	
4,12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4,13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4,14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4,15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-22,975,559	
Stress	6 meses	-17,433,089	
Stress	12 meses	-17,433,089	
Stress	24 meses	-17,433,089	
4,16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
14.508.643/0001-55				
1.3	Data de início			
30/08/2012				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Baixa Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
311685				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001832.6				
1.13	Conta CETIP (nº)			
15879.00-6				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	18:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	18:00
Aplicação inicial mínima		100,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		10,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,80%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos, principalmente, em ativos de renda fixa, indexados a taxas de juros pós-fixadas.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.
O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.	

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.
Revista Exame 2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos Ranking ANBIMA 2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração Revista Investidor Institucional 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais" *TOP ASSET* Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS Rating Fitch Rating – "Forte" Ranking ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)	

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo	
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).
SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Melchior Vinicius dos Santos Felix GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Carlos Eduardo Bitell	
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)	

2.3 - Estratégias e Carteiras		
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente) especifique:		N/A
Global especifique:		N/A
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.	
N/A		
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).	
N/A		
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?	
Não cita.		
2.3.5 – Uso de Derivativos		
2.3.5.1		Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição		Sim
Mudança de remuneração/indexador		Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)		Não cita
Alavancagem		Não
2.3.5.2		Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros		Sim
Câmbio		Não
Ações		Não
Commodities		Não
Em Bolsas:		
· Com garantia		Sim
· Sem garantia		Não
Em balcão:		
· Com garantia		Sim
· Sem garantia		Não
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento		
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N): -
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N): -

3 - Informações Adicionais
3.1 PL atual
454.779.429,74
3.2 PL médio em 12 meses
595.315.646,05

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
57.878.554.515,41	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
324	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
23,27% e 36,09%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicos do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 0
VaR	6 meses 0
VaR	12 meses 0
VaR	24 meses 4
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses 0
Stress	6 meses 0
Stress	12 meses 0
Stress	24 meses -47
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
N/A	Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP				
1.2	CNPJ			
34.660.276/0001-18				
1.3	Data de início			
23/10/2019				
1.4	Classificação CVM			
Multimercado				
1.5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Livre				
1.6	Código ANBIMA			
511031				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo Prazo				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.2086-0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
32276.00-8				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	14:30
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+13	D+15	14:30
Aplicação inicial mínima		50.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		10.000,00		
Resgate Mínimo		5.000,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem em ativos de diferentes naturezas, riscos e características, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		N/A
Brasil (predominantemente)	especifique:	[X] O fundo permite até 20% do seu PL em ativos financeiros negociados no exterior por meio dos fundos investidos e/ou Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I, observadas as regras e condições previstas na legislação vigente.
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
Cotas de fundos que investam até 20% do seu PL em ativos no exterior e/ou Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I.	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Permitido.	

2.3.5 – Uso de Derivativos		
2.3.5.1		Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição		Sim
Mudança de remuneração/indexador		Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)		Não cita
Alavancagem		Não
2.3.5.2		Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros		Sim
Câmbio		Sim
Ações		Sim
Commodities		Sim
Em Bolsas:		
· Com garantia		Sim
· Sem garantia		Não
Em balcão:		
· Com garantia		Sim
· Sem garantia		Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
39.981.068,86	
3.2	PL médio em 12 meses

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
26.149.650.392,15	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
30	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
59,33% e 79,72%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 47,980
VaR	6 meses 47,980
VaR	12 meses 47,980
VaR	24 meses 47,980
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -605,120
Stress	6 meses -605,120
Stress	12 meses -605,120
Stress	24 meses -605,120
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises			
Período	Evento	Comportamento	Explicação
Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
ago/98	Crise da Rússia	N/A	
out/98	Quebra do LTCM	N/A	
jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
abr/01	Apagão	N/A	
set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
jun/02	Marcação a mercado	N/A	
Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	
N/A		Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
Risco de Mercado Externo (vide Regulamento).	
10.3	Qual o produto?
Indiretamente, através de cotas de fundos, ou diretamente através de Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I.	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
Indiretamente, através de cotas de fundos, ou diretamente através de Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I.	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
Indiretamente, através de cotas de fundos, ou diretamente através de Brazilian Depositary Receipts classificados como nível I.	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
15.154.236/0001-50				
1.3	Data de início			
27/11/2012				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
320161				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001838,5				
1.13	Conta CETIP (nº)			
16616,00-0				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		10,000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		1,000,00		
Resgate Mínimo		1,000,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível ao Ibovespa.Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA ETF IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - XBOV11, CNPJ: 14.120.533/0001-11.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	S
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
121.096.920,37	
3.2	PL médio em 12 meses
92.026.251,63	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
995.899.793,17			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
32			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
46,92% e 72,13%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.651.179	
VaR	6 meses	1.765.163	
VaR	12 meses	1.598.899	
VaR	24 meses	1.255.680	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-10.536,245	
Stress	6 meses	-10.403,672	
Stress	12 meses	-8.537,138	
Stress	24 meses	-6.221,095	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP				
1.2	CNPJ			
03.737.206/0001-97				
1.3	Data de início			
05/07/2006				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento				
1.6	Código ANBIMA			
163821				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000123.7				
1.13	Conta CETIP (nº)			
05784.00-8				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,20%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Buscar rentabilidade que acompanhe a variação do CDI.Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito e classificados por agência de risco registrada na CVM.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
4.527.790.510,67	
3.2	PL médio em 12 meses
5.678.667.369,18	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
111.599.105.091,50	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
688	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
43,41% e 50,57%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 555.708
VaR	6 meses 640.333
VaR	12 meses 575.790
VaR	24 meses 326.798
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -22,134,718
Stress	6 meses -20,513,588
Stress	12 meses -30,891,690
Stress	24 meses -35,064,935
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	Evento	Comportamento	Explicação
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
23.215.097/0001-55				
1.3	Data de início			
04/11/2016				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
427583				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado às normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001987,0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
24376,00-2				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,40%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplica em cotas de fundo de investimento em renda fixa, os quais investem, principalmente, em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
9.818.656.120,10	
3.2	PL médio em 12 meses
6.435.198.158,33	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
695			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
19,29% e 27,92%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo de(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	28.882.876	
VaR	6 meses	28.097.724	
VaR	12 meses	24.692.942	
VaR	24 meses	14.315.675	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-735,272,464	
Stress	6 meses	-880,414,729	
Stress	12 meses	-780,088,149	
Stress	24 meses	-428,095,708	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises			
Período	Evento	Comportamento	Explicação
Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
ago/98	Crise da Rússia	N/A	
out/98	Quebra do LTCM	N/A	
jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
abr/01	Apagão	N/A	
set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
jun/02	Marcação a mercado	N/A	
Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)				
Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1. N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.				
3.				

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
N/A	Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
13.058.816/0001-18				
1.3	Data de início			
29/07/2011				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
344872				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001885,7				
1.13	Conta CETIP (nº)			
23309,00-1				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	14:30
Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	14:30
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do Ibovespa.Aplica seus recursos em ativos financeiros de renda variável.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
543.162.917,23	
3.2	PL médio em 12 meses
378.093.571,45	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
995.899.793,17	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
104	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
55,76% e 68,89%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 7.088.799
VaR	6 meses 7.304.872
VaR	12 meses 6.731.246
VaR	24 meses 4.122.950
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -126.126.682
Stress	6 meses -116.697.084
Stress	12 meses -97.132.410
Stress	24 meses -56.828.620
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
N/A	Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
03.737.217/0001-77				
1.3	Data de início			
18/02/2008				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Índice Ativo				
1.6	Código ANBIMA			
204226				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001855.5				
1.13	Conta CETIP (nº)			
08546.00-9				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,70%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,70%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Visa superar, no longo prazo, a rentabilidade do IBX-50.Aplica seus recursos, preponderantemente, em ações, bônus de subscrição, cotas de fundos de investimento em ações e BDRs, selecionados com base na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
1,154,965,783,83	
3.2	PL médio em 12 meses
493,176,813,98	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
1.433.562.436,58	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
86	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
80,72% e 88,53%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 12.868.302
VaR	6 meses 10.600.539
VaR	12 meses 8.515.109
VaR	24 meses 5.976.070
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -225.258.947
Stress	6 meses -170.853.363
Stress	12 meses -125.642.814
Stress	24 meses -80.795.302
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
14.386.926/0001-71				
1.3	Data de início			
16/08/2012				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
310638				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001824,5				
1.13	Conta CETIP (nº)			
23052,00-4				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível com a variação do IDKA IPCA 2A.Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento

2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
8.750.821.084,96	
3.2	PL médio em 12 meses
8.509.845.611,08	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.660.101.434,90			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
964			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
15,59% e 23,76%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	25.018.279	
VaR	6 meses	19.493.579	
VaR	12 meses	16.229.660	
VaR	24 meses	14.124.069	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-342.712.144	
Stress	6 meses	-317.154.790	
Stress	12 meses	-310.061.760	
Stress	24 meses	-227.404.038	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
11.060.913/0001-10				
1.3	Data de início			
09/07/2010				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
251496				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050.00000208,8				
1.13	Conta CETIP (nº)			
19155,00-1				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do 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.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
9.819.854.122,58	
3.2	PL médio em 12 meses
9.657.296.839,02	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.680.101.434,90			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
923			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
23,36% e 30,71%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	29.897.414	
VaR	6 meses	25.474.605	
VaR	12 meses	20.844.465	
VaR	24 meses	13.731.109	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-990.323.338	
Stress	6 meses	-927.754.150	
Stress	12 meses	-729.890.231	
Stress	24 meses	-461.890.393	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
10.577.503/0001-88				
1.3	Data de Início			
18/04/2012				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
301884				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001816,4				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do IMA-B 5+.Investe em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinícius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
2.752.338.813,28	
3.2	PL médio em 12 meses
2.484.184.534,53	

3,3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.660.101.434,90			
3,4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3,5	Número de cotistas		
362			
3,6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3,7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3,8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
34,54% e 44,64%			
3,9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3,10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3,11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4,1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4,2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4,3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4,4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4,5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4,6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4,5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4,7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4,8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5.		
N/A			
4,9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5? Por quê?		
N/A			
4,10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4,11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	35.570.957	
VaR	6 meses	29.319.303	
VaR	12 meses	24.025.051	
VaR	24 meses	23.224.805	
4,12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4,13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4,14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4,15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-598.656.561	
Stress	6 meses	-573.612.828	
Stress	12 meses	-518.957.431	
Stress	24 meses	-426.011.812	
4,16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
10.740.658/0001-93				
1.3	Data de início			
08/03/2010				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
244120				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000205.5				
1.13	Conta CETIP (nº)			
15388.00-5				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do IMA-B.Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos		
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:	
Proteção de carteira ou de posição	Sim	
Mudança de remuneração/indexador	Não cita	
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita	
Alavancagem	Não	
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:	
Juros	Sim	
Câmbio	Não	
Ações	Não	
Commodities	Não	
Em Bolsas:		
· Com garantia	Sim	
· Sem garantia	Não	
Em balcão:		
· Com garantia	Sim	
· Sem garantia	Não	

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
6.698.026.543,95	
3.2	PL médio em 12 meses
9.214.090.310,31	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.660.101.434,90			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
949			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
8% e 14,97%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	51.262.806	
VaR	6 meses	54.349.276	
VaR	12 meses	52.404.517	
VaR	24 meses	36.239.883	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-1,572,982,647	
Stress	6 meses	-1,903,852,252	
Stress	12 meses	-1,760,282,229	
Stress	24 meses	-1,150,787,460	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conferenca calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
11.061.217/0001-28				
1.3	Data de início			
08/07/2010				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
251488				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000208.0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
12516.00-1				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do IMA Geral,Investe seus recursos em títulos públicos federais em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o Índice IMA Geral.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitelli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collers*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
1.431.995.533,36	
3.2	PL médio em 12 meses
1.410.932.852,06	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.660.101.434,90			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
229			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
28,15% e 38,94%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	4.302.320	
VaR	6 meses	3.733.094	
VaR	12 meses	3.489.854	
VaR	24 meses	3.229.752	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-122.829.951	
Stress	6 meses	-120.187.903	
Stress	12 meses	-110.779.029	
Stress	24 meses	-94.171.651	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO				
1.2	CNPJ			
21.918.896/0001-62				
1.3	Data de início			
17/04/2015				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento				
1.6	Código ANBIMA			
392901				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1938-1				
1.13	Conta CETIP (nº)			
21537,00-2				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		18/04/2018		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		300,000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do IPCA + 6% ao ano.Aplica seus recursos em ativos financeiros expostos diretamente ao risco das variações das taxas de juros pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo	
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinícius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras	
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:

Brasil (exclusivamente)	[X]
Brasil (predominantemente) especifique:	N/A
Global especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	
2.3.5 – Uso de Derivativos	

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais	
3.1	PL atual
187.928.458,22	
3.2	PL médio em 12 meses
163.620.175,93	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
68.619.185.597,70			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
76			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
22,33% e 38,77%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	856.546	
VaR	6 meses	730.900	
VaR	12 meses	639.291	
VaR	24 meses	494.581	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress* ?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-19.086.830	
Stress	6 meses	-18.193.362	
Stress	12 meses	-17.131.940	
Stress	24 meses	-10.063.120	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
10.740.670/0001-06				
1.3	Data de início			
28/05/2010				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
248975				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000216.0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
13353.00-5				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital atrelados à variação do IRF-M 1.Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
10.910.469.038,62	
3.2	PL médio em 12 meses
13.701.445.571,66	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.660.101.434,90			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
1.361			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
19,65% e 27,52%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicos do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	9.491.104	
VaR	6 meses	8.280.151	
VaR	12 meses	7.419.550	
VaR	24 meses	7.439.738	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-229.781.221	
Stress	6 meses	-222.618.790	
Stress	12 meses	-194.693.167	
Stress	24 meses	-165.044.361	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
10.577.519/0001-90				
1.3	Data de início			
11/05/2012				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
303887				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001819.9				
1.13	Conta CETIP (nº)			
21737.00-8				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do IRF-M 1+.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré e/ou pós-fixadas.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinícius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinícius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	
2.3.5 – Uso de Derivativos	

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
2.077.044.204,00	
3.2	PL médio em 12 meses
2.021.641.928,45	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.660.101.434,90			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
314			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
35,03% e 46,22%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	6.824.349	
VaR	6 meses	5.451.396	
VaR	12 meses	4.608.214	
VaR	24 meses	6.239.474	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-79.249.835	
Stress	6 meses	-87.425.682	
Stress	12 meses	-112.793.696	
Stress	24 meses	-113.428.713	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
14.508.605/0001-00				
1.3	Data de início			
16/08/2012				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
310646				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001823.7				
1.13	Conta CETIP (nº)			
16582.00-6				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	16:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível com a variação do IRF-M.Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
14.821.342.261,54	
3.2	PL médio em 12 meses
6.187.858.925,89	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
65.660.101.434,90			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
443			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
84,14% e 87,01%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	39.873.197	
VaR	6 meses	26.417.170	
VaR	12 meses	16.857.776	
VaR	24 meses	12.795.680	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-947.607.010	
Stress	6 meses	-588.064.119	
Stress	12 meses	-438.671.873	
Stress	24 meses	-300.828.164	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
23.215.008/0001-70				
1.3	Data de início			
17/12/2015				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento				
1.6	Código ANBIMA			
409278				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1963-2				
1.13	Conta CETIP (nº)			
22784,00-1				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,20%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do CDI.Aplica seus recursos em carteira de ativos financeiros indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas e/ou índices de preços.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinícius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinícius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
1,108,750,074,25	
3.2	PL médio em 12 meses
554,725,154,16	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
68.619.185.597,70	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
66	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
79,29% e 87,21%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 212.604
VaR	6 meses 161.402
VaR	12 meses 87.940
VaR	24 meses 46.922
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -12.919.559
Stress	6 meses -6.058.541
Stress	12 meses -3.702.733
Stress	24 meses -2.168.993
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
05.164.356/0001-84				
1.3	Data de início			
10/02/2006				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
154946				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000115.6				
1.13	Conta CETIP (nº)			
08538.00-0				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplica em carteira composta por 100% de seu patrimônio líquido representado por títulos de emissão do Tesouro Nacional e/ou do Banco Central do Brasil em operações finais e/ou compromissadas.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	
2.3.5 – Uso de Derivativos	

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	

2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
3.186.970.307,05	
3.2	PL médio em 12 meses
2.750.689.949,35	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
34.314.382.531,73	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
376	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
38,85% e 54,58%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 670.066
VaR	6 meses 406.861
VaR	12 meses 285.221
VaR	24 meses 215.331
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -38.966.169
Stress	6 meses -31.368.230
Stress	12 meses -28.830.123
Stress	24 meses -24.350.685
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA				
1.2	CNPJ			
22.791.028/0001-27				
1.3	Data de início			
19/08/2015				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
401854				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,1955-1				
1.13	Conta CETIP (nº)			
23080,00-7				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		16/08/2020		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		300.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Acompanhar o IMA-B.Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Alocando exclusivamente em NTB-B com vencimento em 2020.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
Brasil (exclusivamente)	[X]
Brasil (predominantemente) especifique:	N/A
Global especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
262.800.930,14	
3.2	PL médio em 12 meses
257.543.703,14	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
45			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
50,46% e 67,8%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicos do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	321.189	
VaR	6 meses	256.414	
VaR	12 meses	249.085	
VaR	24 meses	385.187	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-911.555	
Stress	6 meses	-953.323	
Stress	12 meses	-2.715.386	
Stress	24 meses	-4.399.340	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estratégia adotada pelo Administrador/Gestor e pelas características do produto.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO				
1.2	CNPJ			
29.388.994/0001-47				
1.3	Data de início			
13/08/2018				
1.4	Classificação CVM			
Multimercado				
1.5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Capital Protegido				
1.6	Código ANBIMA			
473006				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo Prazo				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
0238-050-2055-0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
28000.00-8				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	14:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		01/10/2020		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+2 du	14:00
Aplicação inicial mínima		5.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		500,00		
Resgate Mínimo		500,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,60%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,60%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do CAIXA MASTER CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FI MULTIMERCADO, CNPJ: 30.036.170/0001-97.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Permitido.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
498.921.994,50	
3.2	PL médio em 12 meses
481.891.019,88	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.699.695.078,20			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
955			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
14% e 24,33%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.970.344	
VaR	6 meses	2.061.856	
VaR	12 meses	2.323.227	
VaR	24 meses	2.791.015	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-11.531.999	
Stress	6 meses	-12.836.299	
Stress	12 meses	-16.704.999	
Stress	24 meses	-18.754.215	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	Evento	Comportamento	Explicação
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estrutura do mesmo e pelas características da estratégia montada.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1,1	Nome			
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO				
1,2	CNPJ			
14.386.860/0001-10				
1,3	Data de início			
17/01/2018				
1,4	Classificação CVM			
Multimercado				
1,5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Capital Protegido				
1,6	Código ANBIMA			
457213				
1,7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1,8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo prazo				
1,9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1,10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1,11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1,12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
0238-050-2039-8				
1,13	Conta CETIP (nº)			
26883,00-5				
1,14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1,16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1,17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1,18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1,19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	14:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		02/01/2020		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+2 du	14:00
Aplicação inicial mínima		5.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		500,00		
Resgate Mínimo		500,00		
1,20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1,21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1,22	Taxa de Administração			
1,60%				
1,23	Taxa de Administração máxima			
1,60%				
1,24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1,25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1,26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1,27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2,1 – Perfil				
2,1,1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento que apliquem em títulos públicos federais ou em operações com derivativos vinculados ao Ibovespe.				
2,1,2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2,1,3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
Brasil (exclusivamente)	[X]
Brasil (predominantemente) especifique:	N/A
Global especifique:	N/A
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Permitido.	
2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	

2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
280,149,446.10	
3.2	PL médio em 12 meses
276,504,257.63	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.689.695.078,20			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
730			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
12,54% e 22,61%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicos do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	9.227.763	
VaR	6 meses	6.058.579	
VaR	12 meses	3.969.127	
VaR	24 meses	2.971.808	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-4.928.151	
Stress	6 meses	-5.587.019	
Stress	12 meses	-7.347.804	
Stress	24 meses	-10.104.195	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	Evento	Comportamento	Explicação
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estrutura do mesmo e pelas características da estratégia montada.		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO				
1.2	CNPJ			
22.790.987/0001-28				
1.3	Data de início			
23/09/2019				
1.4	Classificação CVM			
Multimercado				
1.5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Capital Protegido				
1.6	Código ANBIMA			
510831				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo Prazo				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00002080-0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
31687,00-7				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	Não informado
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		27 meses		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+2 du	Não informado
Aplicação inicial mínima		5.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		500,00		
Resgate Mínimo		500,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,60%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,60%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do CAIXA MASTER CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FI MULTIMERCADO, CNPJ: 30.068.286/0001-08.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.	
N/A		
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).	
N/A		
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?	
Permitido.		
2.3.5 – Uso de Derivativos		
2.3.5.1		Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição		Sim
Mudança de remuneração/indexador		Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)		Não cita
Alavancagem		Não
2.3.5.2		Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros		Sim
Câmbio		Não
Ações		Sim
Commodities		Não
Em Bolsas:		
· Com garantia		Sim
· Sem garantia		Não
Em balcão:		
· Com garantia		Sim
· Sem garantia		Não
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento		
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N): N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N): S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
100.661.181,30	
3.2	PL médio em 12 meses

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.699.695.078,20			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
723			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
30,68% e 40,48%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	2.035.329	
VaR	6 meses	1.915.616	
VaR	12 meses	1.915.616	
VaR	24 meses	1.915.616	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-7.155.672	
Stress	6 meses	-6.785.851	
Stress	12 meses	-6.785.851	
Stress	24 meses	-6.785.851	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
	Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo foi fechado para novas aplicações em função da estrutura do mesmo e pelas características da estratégia montada.	
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	
9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	
10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
10.551.375/0001-01				
1.3	Data de início			
22/08/2008				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Setoriais				
1.6	Código ANBIMA			
230049				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001856.3				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
2,00%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
2,00%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter no longo prazo o máximo retorno absoluto,Aplica seus recursos em carteira composta por ações de emissão de companhias do setor de construção civil e/ou ações de companhias que sejam fornecedoras diretas e que tem seus resultados vinculados ao desempenho do setor.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
587,424,602.29	
3.2	PL médio em 12 meses
77,373,191.00	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
1.800.254.506,31	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
10.018	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
22,43% e 25,54%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 3.863.036
VaR	6 meses 2.599.991
VaR	12 meses 1.585.789
VaR	24 meses 1.031.473
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -53.066.041
Stress	6 meses -34.156.012
Stress	12 meses -21.352.066
Stress	24 meses -13.504.740
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
10.577.512/0001-79				
1.3	Data de início			
26/04/2012				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Setoriais				
1.6	Código ANBIMA			
302198				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001818,0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		10,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		10,00		
Resgate Mínimo		5,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,60%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,60%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplica seus recursos em valores mobiliários negociados em bolsa, que possuam relação direta ou indireta com o setor de consumo. No mínimo 67% de sua carteira será composta por ações, bônus ou recibos de subscrição, cotas de FIAs e BDRs.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.
O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.	
2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.
Revista Exame 2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos Ranking ANBIMA 2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração Revista Investidor Institucional 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais" TOP ASSET Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS Rating Fitch Rating – "Forte" Ranking ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)	
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo	
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).
SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Melchior Vinicius dos Santos Felix GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Carlos Eduardo Bitel	
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)	
2.3 - Estratégias e Carteiras	
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
Brasil (exclusivamente)	[X]
Brasil (predominantemente) especifique:	N/A
Global especifique:	N/A
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	
2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	
2.3.6.1	de fundos de terceiros? (S/N): N
2.3.6.2	de fundos do gestor? (S/N): S
3 - Informações Adicionais	
3.1	PL atual
728.075.712,70	
3.2	PL médio em 12 meses
178.855.796,04	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
1.800.254.506,31	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
11.929	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
49,56% e 52,83%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 6.717.475
VaR	6 meses 4.708.506
VaR	12 meses 2.992.319
VaR	24 meses 1.852.367
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -138.206.220
Stress	6 meses -91.590.842
Stress	12 meses -56.046.316
Stress	24 meses -33.229.066
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
	Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
05.900.798/0001-41				
1.3	Data de início			
03/10/2003				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Dividendos				
1.6	Código ANBIMA			
121241				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00000095,8				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Proporcionar ganhos de capital a longo prazo.Aplica seus recursos em ações de empresas que possuam a politica e/ou potencial de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
263.014.736,57	
3.2	PL médio em 12 meses
101.137.541,62	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
263.014.736,57			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
4.665			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
17,38% e 24%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.964.603	
VaR	6 meses	1.713.850	
VaR	12 meses	1.426.198	
VaR	24 meses	1.268.379	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-33.603.445	
Stress	6 meses	-27.216.074	
Stress	12 meses	-20.482.910	
Stress	24 meses	-16.137.424	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização			
1.1	Nome		
CAIXA IBOVESPA FIC AÇÕES			
1.2	CNPJ		
01.525.057/0001-77			
1.3	Data de início		
15/01/1997			
1.4	Classificação CVM		
Ações			
1.5	Classificação ANBIMA		
Ações Indexados			
1.6	Código ANBIMA		
41025			
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?		
N/A			
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)		
Ações			
1.9	Público-alvo		
Investidores em geral			
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?		
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.			
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?		
Não			
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)		
104,0238,050,00000002,8			
1.13	Conta CETIP (nº)		
N/A			
1.14	Administração (indique contato para informações).		
Caixa Econômica Federal			
1.15	Custódia (indique contato para informações).		
Caixa Econômica Federal			
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).		
KPMG			
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:		
Escriturador	N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)	N/A		
Consultor Especializado	N/A		
Assessor Jurídico	N/A		
Seguradora	N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento	
1.19	Regras para aplicação e resgate:		
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação Inicial mínima	1.000,00		
Aplicação máxima por cotista	N/A		
Aplicação adicional mínima	100,00		
Resgate Mínimo	100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)		
N/A			
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)		
N/A			
1.22	Taxa de Administração		
4,00%			
1.23	Taxa de Administração máxima		
4,00%			
1.24	Taxa de Performance		
%	Não possui		
Benchmark	Não possui		
Frequência	Não se aplica		
Linha-d'água	Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?		
0,05%			
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?		
N/A			
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?		
N/A			
2 - Informações Qualitativas			
2.1 – Perfil			
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.		
Acompanhar o Ibovespa.Aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimentos de ações.			
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.		
N/A			
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.		
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.			

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
193.462.646,58	
3.2	PL médio em 12 meses
150.013.954,68	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
995.899.793,17			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
4.306			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
17,13% e 22,35%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	2.526.447	
VaR	6 meses	2.625.597	
VaR	12 meses	2.704.007	
VaR	24 meses	2.428.143	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-45,150,408	
Stress	6 meses	-42,050,394	
Stress	12 meses	-38,495,600	
Stress	24 meses	-31,085,373	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Periodo	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Periodo	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
N/A	Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal de carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
10.551.382/0001-03				
1.3	Data de início			
19/04/2010				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Setoriais				
1.6	Código ANBIMA			
246700				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001854.7				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
2,00%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
2,00%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas,Aplica seus recursos, principalmente, em ações de empresas dos setores da economia que estejam ligados direta ou indiretamente à infraestrutura, mediante análise dos cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
484.754.191,32	
3.2	PL médio em 12 meses
138.052.699,46	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.800.254.508,31			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
8.164			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
8,8% e 12,97%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	3.795.514	
VaR	6 meses	3.178.066	
VaR	12 meses	2.262.103	
VaR	24 meses	1.741.123	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-77,147,504	
Stress	6 meses	-56,522,757	
Stress	12 meses	-37,379,929	
Stress	24 meses	-25,873,013	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:		Data:
Nome:		
Cargo:		

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I				
1.2	CNPJ			
17.502.837/0001-68				
1.3	Data de início			
24/06/2013				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Livre				
1.6	Código ANBIMA			
339075				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores institucionais				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001877,6				
1.13	Conta CETIP (nº)			
17575,00-9				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		10.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		500,00		
Resgate Mínimo		500,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,70%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,70%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinícius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		N/A
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	[X] O fundo possui limite mínimo de 67% e máximo de 100% do seu PL em Brazilian Depositary Receipts - BDRs.

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
Brazilian Depositary Receipts classificados como nível II e III.	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
658.217.495,50	
3.2	PL médio em 12 meses
523.487.183,52	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
1.673.697.615,26	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
67	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
55,48% e 72,89%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 8.531.580
VaR	6 meses 8.109.349
VaR	12 meses 8.162.397
VaR	24 meses 6.525.360
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -124,280,344
Stress	6 meses -118,424,989
Stress	12 meses -112,876,744
Stress	24 meses -87,085,289
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises			
Período	Evento	Comportamento	Explicação
Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
ago/98	Crise da Rússia	N/A	
out/98	Quebra do LTCM	N/A	
jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
abr/01	Apagão	N/A	
set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
jun/02	Marcação a mercado	N/A	
Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)				
Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1. N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.				
3.				

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
Risco proveniente de mercado externo (vide Regulamento).	
10.3	Qual o produto?
Brazilian Depositary Receipts - BDRs Não Patrocinados Nível I e Brazilian Depositary Receipts - BDRs Patrocinados - classificados como Nível I, Nível II ou Nível III	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
Investir no mínimo 67% e no máximo de 100% do seu PL em Brazilian Depositary Receipts - BDRs.	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
Brazilian Depositary Receipts.	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP				
1.2	CNPJ			
14.120.520/0001-42				
1.3	Data de início			
28/08/2012				
1.4	Classificação CVM			
Multimercado				
1.5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Juros e Moedas				
1.6	Código ANBIMA			
307122				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo Prazo				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001821.0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
15384.00-3				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		100.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		1.000,00		
Resgate Mínimo		1.000,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,70%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,70%				
1.24	Taxa de Performance			
%		0,2		
Benchmark		100% do CDI		
Frequência		Semestral (Janeiro e Julho)		
Linha-d'água		High water mark		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplica seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros no mercado de taxas de juros prefixadas e pós-fixadas, no mercado de câmbio e de indexadores de preços. Pode investir em ativos negociados no exterior.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		N/A
Brasil (predominantemente)	especifique:	[X] *O fundo permite até 20% do seu PL em ativos financeiros negociados no exterior, diretamente ou por meio dos fundos investidos, observadas as regras e condições previstas na legislação vigente*
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.

Variação Cambial.

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).

N/A

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?

Permitido.

2.3.5 – Uso de Derivativos

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Sim
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento

2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
723.804.825,28	
3.2	PL médio em 12 meses
383.376.623,21	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.746.061.226,64			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
2.441			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
18,01% e 21,95%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	409.622	
VaR	6 meses	249.019	
VaR	12 meses	208.367	
VaR	24 meses	220.058	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-7.760.716	
Stress	6 meses	-5.752.739	
Stress	12 meses	-4.721.242	
Stress	24 meses	-3.705.722	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
Risco proveniente de mercado externo (vide Regulamento).	
10.3	Qual o produto?
Variação Cambial.	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
Variação Cambial.	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
A carteira do Fundo ou dos fundos investidos estarão expostos diretamente, ou através do uso de derivativos à variação cambial.	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP				
1.2	CNPJ			
10.646.895/0001-90				
1.3	Data de início			
27/10/2009				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Indexados				
1.6	Código ANBIMA			
236365				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000181.4				
1.13	Conta CETIP (nº)			
09330.00-1				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,20%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade que acompanhe a variação do subíndice IMA-B.Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Vedado.
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
3.047.753.091,50	
3.2	PL médio em 12 meses
2.672.616.076,99	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
65.660.101.434,90	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
305	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
31,41% e 41,48%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 21.129.891
VaR	6 meses 17.989.654
VaR	12 meses 15.490.115
VaR	24 meses 13.208.763
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -637.879.121
Stress	6 meses -608.010.274
Stress	12 meses -514.015.109
Stress	24 meses -406.047.239
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
03.914.671/0001-56				
1.3	Data de início			
10/07/2000				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Fundos de Mono Ação				
1.6	Código ANBIMA			
80292				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00000049,4				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplicar, no mínimo, 67% do Patrimônio Líquido em ações da Petrobrás e, no máximo, 33% do PL em Títulos Públicos do TN e/ou BCB, operações compromissadas e/ou cotas de fundos.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
748.529.681,85	
3.2	PL médio em 12 meses
766.955.845,26	

3,3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.738.845.788,42			
3,4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3,5	Número de cotistas		
27.401			
3,6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3,7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3,8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
2,49% e 2,85%			
3,9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3,10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3,11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4,1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4,2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4,3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4,4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4,5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4,6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4,5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4,7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4,8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5.		
N/A			
4,9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5? Por quê?		
N/A			
4,10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4,11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	18.807.367	
VaR	6 meses	19.991.108	
VaR	12 meses	23.043.252	
VaR	24 meses	24.348.101	
4,12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4,13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4,14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4,15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-192.929.157	
Stress	6 meses	-190.842.387	
Stress	12 meses	-196.258.585	
Stress	24 meses	-170.865.625	
4,16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
	Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA PETROBRAS PRÉ-SAL FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
11.060.594/0001-42				
1.3	Data de início			
28/09/2010				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Fundos de Mono Ação				
1.6	Código ANBIMA			
257109				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00000225,0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		100,000.00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
0,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos, principalmente, em ações preferenciais de emissão da Petrobras.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
90.586.554,94	
3.2	PL médio em 12 meses
70.607.115,74	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.735.845.788,42			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
2.838			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
19,5% e 25,59%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	2.102.074	
VaR	6 meses	2.052.178	
VaR	12 meses	2.098.845	
VaR	24 meses	1.976.675	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-15.437.967	
Stress	6 meses	-14.455.004	
Stress	12 meses	-13.263.176	
Stress	24 meses	-10.251.631	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	
N/A		Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				
1.2	CNPJ			
05.164.364/0001-20				
1.3	Data de início			
18/07/2005				
1.4	Classificação CVM			
Renda Fixa				
1.5	Classificação ANBIMA			
Renda Fixa Duração Livre Soberano				
1.6	Código ANBIMA			
157244				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Previdência				
1.9	Público-alvo			
Exclusivo previdenciário				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000109.1				
1.13	Conta CETIP (nº)			
20641.00-9				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
0,20%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
Não possui				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas (SELIC/CDI).				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2018 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim
Câmbio	Não
Ações	Não
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
140.059.639,22	

3.2	PL médio em 12 meses
196.801.592,61	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
34.314.382.531,73			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
86			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
45,84% e 63,23%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	30.895	
VaR	6 meses	20.359	
VaR	12 meses	17.737	
VaR	24 meses	18.070	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress* ?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-2,051,025	
Stress	6 meses	-2,029,937	
Stress	12 meses	-2,165,413	
Stress	24 meses	-2,378,770	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição
N/A	Contribuição (%)
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP				
1.2	CNPJ			
03.737.188/0001-43				
1.3	Data de início			
20/06/2000				
1.4	Classificação CVM			
Multimercado				
1.5	Classificação ANBIMA			
Multimercados Balanceados				
1.6	Código ANBIMA			
94552				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Longo Prazo				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
0238,050,00000046,0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
61308,00-2				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Banco Bradesco				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+0	D+0	14:30
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	14:30
Aplicação inicial mínima		500,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,00%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,00%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros, no âmbito do mercado financeiro e de capitais nacional e internacional, não podendo deter mais de 30% em ativos de renda variável.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Biteli

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		N/A
Brasil (predominantemente)	especifique:	[X] *O fundo permite até 20% do seu PL em ativos financeiros negociados no exterior, diretamente ou por meio dos fundos investidos, observadas as regras e condições previstas na legislação vigente*
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
Brazilian Depositary Receipts classificados como nível II e III.	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Permitido.	

2.3.5 – Uso de Derivativos		
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:	
Proteção de carteira ou de posição	Sim	
Mudança de remuneração/indexador	Sim	
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita	
Alavancagem	Não	
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:	
Juros	Sim	
Câmbio	Sim	
Ações	Sim	
Commodities	Sim	
Em Bolsas:		
· Com garantia	Sim	
· Sem garantia	Não	
Em balcão:		
· Com garantia	Sim	
· Sem garantia	Não	

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	S
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
2,504,561,373,12	
3.2	PL médio em 12 meses
849,388,100,62	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
2.504.561.373,12			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
18.924			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
7,23% e 11,32%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	5.022.249	
VaR	6 meses	4.571.408	
VaR	12 meses	4.336.907	
VaR	24 meses	3.579.053	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-27.070.363	
Stress	6 meses	-21.199.567	
Stress	12 meses	-18.002.427	
Stress	24 meses	-13.820.354	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
Os investidores estarão expostos às variações de preços de um ativo estrangeiro.	
10.3	Qual o produto?
Valores mobiliários de companhias estrangeiras.	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
Investir até 20% do PL do fundo em Brazilian Depositary Receipts classificados como nível II e III.	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
Brazilian Depositary Receipts.	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
15.154.220/0001-47				
1.3	Data de início			
01/11/2012				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Small Caps				
1.6	Código ANBIMA			
317594				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001837,7				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		100,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		50,00		
Resgate Mínimo		50,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade superior ao SMLL.Aplica seus recursos em carteira composta por diversos ativos de empresas de menor capitalização no mercado, baseando-se em cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinícius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinícius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
1.147.989.407,83	
3.2	PL médio em 12 meses
424.811.796,21	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
1.147.989.407,83	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
12.392	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
41,53% e 47,12%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada *diariamente, conforme* limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 10.318.128
VaR	6 meses 8.934.616
VaR	12 meses 6.946.074
VaR	24 meses 5.892.722
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -163.387.661
Stress	6 meses -128.415.228
Stress	12 meses -98.507.894
Stress	24 meses -77.122.173
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
Sim, o fundo ficou fechado temporariamente para aplicação em função do tamanho do Patrimônio Líquido e da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	
9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	
10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL ISE FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
08.070.838/0001-63				
1.3	Data de início			
05/11/2007				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Sustentabilidade/Governança				
1.6	Código ANBIMA			
197734				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00000130,0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		500,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,50%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,50%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter rentabilidade compatível à variação do ISE.Aplica seus recursos em carteira composta por ativos financeiros de empresas que apresentam bons níveis de governança corporativa, ou que se destaquem em responsabilidade social e sustentabilidade empresarial no longo prazo.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
13.784.147,99	
3.2	PL médio em 12 meses
4.045.070,06	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
13.784.147,99			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
753			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
25,76% e 36,26%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	76,647	
VaR	6 meses	69,154	
VaR	12 meses	70,047	
VaR	24 meses	64,147	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-1.694,015	
Stress	6 meses	-1.380,565	
Stress	12 meses	-1.242,721	
Stress	24 meses	-1.087,570	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES				
1.2	CNPJ			
04.885.820/0001-69				
1.3	Data de início			
20/02/2002				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Fundos de Mono Ação				
1.6	Código ANBIMA			
99795				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00000072,9				
1.13	Conta CETIP (nº)			
N/A				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	17:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+3 du	17:00
Aplicação inicial mínima		1.000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		100,00		
Resgate Mínimo		100,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
2,00%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
2,00%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capital.Aplicar, no mínimo, 67% do Patrimônio Líquido em ações da Vale e, no máximo, 33% do PL em Títulos Públicos do TN e/ou BCB, operações compromissadas e/ou cotas de fundos.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Não cita.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Não cita
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Não cita
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
566.893.586,49	
3.2	PL médio em 12 meses
555.791.097,00	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.736.845.788,42			
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3.5	Número de cotistas		
18.668			
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
1,9% e 3,29%			
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.		
N/A			
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?		
N/A			
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	14.759.371	
VaR	6 meses	15.045.456	
VaR	12 meses	21.201.419	
VaR	24 meses	21.268.418	
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-136.655.782	
Stress	6 meses	-136.776.989	
Stress	12 meses	-143.141.741	
Stress	24 meses	-154.503.652	
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição — Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos				
11.1	Regulamento	Sim		Não
11.2	Prospecto	Sim		Não
11.3	Última lâmina	Sim		Não
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES				
1.2	CNPJ			
15.154.441/0001-15				
1.3	Data de início			
23/08/2012				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Dividendos				
1.6	Código ANBIMA			
311383				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104,0238,050,00001829,6				
1.13	Conta CETIP (nº)			
15761.00-4				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+30 du	D+32 du	15:00
Aplicação inicial mínima		100,000.00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		0,00		
Resgate Mínimo		0,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,72%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,72%				
1.24	Taxa de Performance			
%		Não possui		
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FI AÇÕES, CNPJ: 15.154.458/0001-72.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2015 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitel

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Vedado.
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Vedado.
Alavancagem	Não
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	(S/N):	N
2.3.6.2	de fundos do gestor?	(S/N):	S

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
842,981,450.04	
3.2	PL médio em 12 meses
640,245,790.89	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
263.014.736,57	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.	
3.5	Número de cotistas
141	
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
N/A	
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
N/A	
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
32,19% e 46,48%	
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
N/A	- - -
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
Desde o início	
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
N/A	
4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicos do Fundo.
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
N/A	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto *stress*)?
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
Não há estimativa	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
VaR	3 meses 10.207.250
VaR	6 meses 11.219.077
VaR	12 meses 10.160.877
VaR	24 meses 8.847.011
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos
Stress	3 meses -149,165,188
Stress	6 meses -140,538,801
Stress	12 meses -120,614,956
Stress	24 meses -96,752,808
4.16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)		
7.1	Atribuição	Contribuição (%)
N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).	
N/A		
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?	
N/A		

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos

ANBIMA

Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART - VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

31/12/2019

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A")

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização

2 - Informações Qualitativas

2.1 - Perfil

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.3 - Estratégias e Carteiras

3 - Informações Adicionais

4 - Gestão de Risco

5 - Comportamento do Fundo em Crises

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (peak to valley)

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores

9 – Atendimento aos Cotistas

10 - Investimento no Exterior

11 – Anexos

2) Declaração

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento ("Questionário Due Diligence") é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização				
1.1	Nome			
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES				
1.2	CNPJ			
14.507.698/0001-95				
1.3	Data de início			
12/12/2011				
1.4	Classificação CVM			
Ações				
1.5	Classificação ANBIMA			
Ações Livre				
1.6	Código ANBIMA			
292591				
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?			
N/A				
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)			
Ações				
1.9	Público-alvo			
Investidores em geral				
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?			
Não, porém ele cita que o Regulamento está adequado as normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social.				
1.11	Exclusivamente para investidor qualificado?			
Não				
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)			
104.0238.050.00001794.0				
1.13	Conta CETIP (nº)			
14526.00-5				
1.14	Administração (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.15	Custódia (indique contato para informações).			
Caixa Econômica Federal				
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).			
KPMG				
1.17	No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:			
Escriturador		N/A		
Agente de depósito (Custódia Física)		N/A		
Consultor Especializado		N/A		
Assessor Jurídico		N/A		
Seguradora		N/A		
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento		
1.19	Regras para aplicação e resgate:			
Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)		D+1 du	D+0	15:00
Carência/Tempo mínimo para permanência (*lock-up period*) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.		Não há		
Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)		D+21 du	D+23 du	15:00
Aplicação inicial mínima		100,000,00		
Aplicação máxima por cotista		N/A		
Aplicação adicional mínima		10,000,00		
Resgate Mínimo		10,000,00		
1.20	Taxa de Entrada (*upfront fee*)			
N/A				
1.21	Taxa de Saída (*redemption fee*)			
N/A				
1.22	Taxa de Administração			
1,72%				
1.23	Taxa de Administração máxima			
1,72%				
1.24	Taxa de Performance			
%				
Benchmark		Não possui		
Frequência		Não se aplica		
Linha-d'água		Não se aplica		
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?			
0,05%				
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?			
N/A				
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?			
N/A				
2 - Informações Qualitativas				
2.1 – Perfil				
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.			
Obter ganhos de capitalAplica seus recursos, principalmente, em cotas do VINCI CAIXA VALOR FI AÇÕES, CNPJ: 14.507.581/0001-93.				
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.			
N/A				
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.			
O modelo de gestão adotado demonstra a tomada de decisão compartilhada, com a existência de comitês previstos no estatuto. O poder decisório descentralizado e compartilhado minimiza o risco de concentração das decisões. O processo é focado no atendimento aos objetivos dos clientes, atuando de acordo com as características de cada produto, procurando obter o máximo retorno com o menor risco possível. A administração é feita com plena diligência e fundada na boa prática de gestão com estrita observância da política de investimento definida nos regulamentos e contratos, além das regras legais e regulares.				

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

O modelo de decisão para a definição das estratégias de investimento dos fundos administrados pela CAIXA é definido por comitês. O Comitê de Investimento se reúne quinzenalmente de forma regular e, extraordinariamente, quando necessário, tendo como objetivo a definição de estratégias de alocação, análise de cenário macroeconômico e exposição ao risco. O Comitê Tático se reúne diariamente para analisar as notícias, as perspectivas de mercado, as propostas de alocação e definir a atuação para o dia. As deliberações são tomadas após decisões e votação por parte dos integrantes. A gestão conta ainda com o Comitê de Riscos que analisa e aprova a política de aquisição de títulos privados nos fundos de investimento, observando as diretrizes emanadas pelo Comitê de Planejamento e Gestão.

2.1.5	Cite as premiações, *ratings* e *rankings*.

Revista Exame
2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos

Ranking ANBIMA
2019 - 4° lugar do Ranking geral de recursos sob Administração

Revista Investidor Institucional
2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais
2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais"

TOP ASSET
Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional, Maior Gestora de RPPS

Rating
Fitch Rating – "Forte"

Ranking
ANBIMA – 1° lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)

2.2 - Equipe de Gestão do Fundo

2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).

SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL
Melchior Vinicius dos Santos Felix
GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA
Carlos Eduardo Bitell

2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.

Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Bitell (Gerente Executivo da GEFIX)
Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinicius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)

2.3 - Estratégias e Carteiras

2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:	
Brasil (exclusivamente)		[X]
Brasil (predominantemente)	especifique:	N/A
Global	especifique:	N/A

2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.
N/A	

2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: *stop loss*, *stop gain*, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).
N/A	

2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Vedado.	

2.3.5 – Uso de Derivativos

2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
Proteção de carteira ou de posição	Sim
Mudança de remuneração/indexador	Vedado.
Estratégias combinadas (*floors*, *caps*, *collars*, *spreads*, *straddles*, *box*, financiamentos com termo etc.)	Vedado.
Alavancagem	Não

2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Não
Câmbio	Não
Ações	Sim
Commodities	Não
Em Bolsas:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não
Em balcão:	
· Com garantia	Sim
· Sem garantia	Não

2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento

2.3.6.1			
2.3.6.2	de fundos de terceiros?	(S/N):	-
	de fundos do gestor?	(S/N):	-

3 - Informações Adicionais

3.1	PL atual
368.895.553,65	
3.2	PL médio em 12 meses
205.485.683,27	

3,3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa		
1.673.697.615,26			
3,4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?		
Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.			
3,5	Número de cotistas		
80			
3,6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?		
N/A			
3,7	Descreva as regras de concentração de passivo		
N/A			
3,8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas		
28,58% e 45,35%			
3,9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?		
N/A	-	-	-
3,10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?		
Desde o início			
3,11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?		
N/A			
4 - Gestão de Risco			
4,1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.		
A exposição ao risco de crédito é acompanhada e monitorada diariamente, conforme limites e critérios estabelecidos e aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VIART e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros da CAIXA. Os limites de risco de crédito são definidos levando-se em consideração limites de concentração por tomador, garantia, produto e segmento.			
4,2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.		
O gerenciamento do risco de liquidez é feito considerando-se: o fluxo de caixa, o indicador de liquidez, o cronograma de vencimentos e o perfil de concentração de cotistas do fundo por faixa de valores. O controle do fluxo de caixa de cada produto é realizado com base nas entradas e saídas de recursos, sendo considerado como entradas as aplicações e parcelas de juros e/ou principal dos ativos alocados nas carteiras dos fundos de investimento e como saídas, os resgates de acordo com a cotização do fundo, e as despesas administrativas dos fundos. Para os fundos que existe controle de aplicação e resgate on-line o cálculo do fluxo de caixa é realizado considerando-se as aplicações e regates on-line. Na mensuração do volume de ativos líquidos primeiramente os ativos são classificados como líquidos ou ilíquidos de acordo com suas características. Os ativos a priori classificados como líquidos são reavaliados considerando o número de negócios no mercado secundário em um período, podendo ser reclassificado como ilíquido. As informações de negócios utilizadas são as do mercado secundário disponibilizados pelo BACEN/ANBIMA para títulos públicos, pela BMFBOVESPA para ações/opções e contratos futuros e pela SND/BOVESPAFIX para títulos privados. Para os ativos classificados como líquido é calculado o potencial volume de negociação diária considerando-se a média de negócios multiplicada pelo preço de mercado, e verificado o volume líquido diário do ativo para cada fundo considerando-se seu prazo de cotização. É realizado monitoramento do volume aplicado e a quantidade de cotistas por produto e por tipo de cliente (Pessoa Física, Pessoa Jurídica, Entidade Pública e Instituição Financeira), observando-se a concentração do patrimônio líquido entre os dez maiores investidores, por tipo de cliente e a relação entre o volume aplicado pelo maior cliente do fundo e volume líquido do fundo.			
4,3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.		
N/A			
4,4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?		
1 Dentre as classes de ativos que possuem títulos de baixa liquidez, temos as seguintes fontes para a precificação: * Renda Fixa: para os títulos emitidos por Instituições Financeiras o apreçamento é realizado considerando as informação de negócios CETIP e cotação junto aos emissores; e para as debêntures tomamos como proxy as taxas da ANBIMA ou negócios realizados na CETIP com debêntures cujas características se aproximem da emissão precificada; * Renda Variável: para o BDR - Brazilian Depositary Receipt utilizamos os preços referenciais da BM&FBovespa. 2 Para todas as classes acima, os casos não observados pela metodologia são levados para decisão no Comitê de Marcação a Mercado.			
4,5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, *Tracking Error* e *Expected Shortfall*)?		
VaR Paramétrico TH 1 dia com 95% de confiança.			
4,6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4,5		
No Alerta Vermelho caso o gestor considere que a posição deve ser mantida o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, pela Conformidade da VIART – GERAT Conformidade, para avaliação e tomada de decisão. A decisão tomada pelo Comitê de Planejamento e Gestão é reportada ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Caso o gestor reenquadre o fundo nos limites estabelecidos o Comitê de Planejamento e Gestão e o Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros são comunicados da ocorrência			
4,7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5 (exceto *stress*)?		
O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco.			
4,8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5.		
N/A			
4,9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5? Por quê?		
N/A			
4,10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4,5 registrado pelo Fundo? Comente.		
Não há estimativa			
4,11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos		
VaR	3 meses	1.231.490	
VaR	6 meses	1.365.447	
VaR	12 meses	1.286.333	
VaR	24 meses	1.178.468	
4,12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?		
N/A			
4,13	Qual o limite para perdas em cenário de *stress*?		
N/A			
4,14	Quando atingiu o limite? Por quê?		
N/A			
4,15	Qual o *stress* médio do Fundo nos últimos		
Stress	3 meses	-21.558.793	
Stress	6 meses	-19.224.041	
Stress	12 meses	-17.010.991	
Stress	24 meses	-15.284.006	
4,16	Comente o último *stop loss* relevante do Fundo.		
N/A			

5 – Comportamento do Fundo em Crises				
	Período	**Evento**	**Comportamento**	**Explicação**
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	
	ago/98	Crise da Rússia	N/A	
	out/98	Quebra do LTCM	N/A	
	jan/99	Desvalorização do Real	N/A	
	mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	
	abr/01	Apagão	N/A	
	set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	
	jun/02	Marcação a mercado	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	
	mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	

6 - Três períodos de maior perda do Fundo (*peak to valley*)					
	Período	**Evento**	**Perda**	**Explicação**	**Tempo para Recuperação**
1.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
2.					
3.					

7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	
7.1	Atribuição / Contribuição (%)
N/A	
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).
N/A	
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?
N/A	

8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
Controlador não fornece relatórios do fundo para Distribuidor.	
8.3	Com que frequência é possível realizar *conference calls* com o gestor dos fundos?
A qualquer momento, apenas sujeito à disponibilidade do Gestor.	

9 – Atendimento aos Cotistas	
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?
Diariamente são fornecidos relatórios com informações da cota diária, Patrimônio Líquido, rentabilidade do dia e acumulada no mês/ano/12 meses. Mensalmente são fornecidos os extratos consolidados de cada aplicação do cliente.	
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?
São enviadas informações diariamente via e-mail e disponibilizadas na página do Administrador na internet.	
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?
A GEICO atende diretamente os cotistas, via telefone, e-mail ou pessoalmente.	

10 - Investimento no Exterior	
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo	
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?
N/A	
10.2	Quais os riscos envolvidos?
N/A	
10.3	Qual o produto?
N/A	
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?
N/A	
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?
N/A	
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, *prime broker*, entre outros)
N/A	
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.
N/A	
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?
N/A	
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.
N/A	

11 – Anexos					
11.1	Regulamento	Sim		Não	
11.2	Prospecto	Sim		Não	
11.3	Última lâmina	Sim		Não	
11.4	Último Informe de Perfil Mensal da carteira	Sim		Não	
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo	Sim		Não	
11.6	Relatórios de Gestão	Sim		Não	

2) Declaração

Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

Assinatura: _____

3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
1.2	Alteração de dados de contato
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos