

ANEXO I – FUNDOS DE INVESTIMENTO

1. Alterações desde a última atualização

1.1	Nome do fundo	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA
1.2	CNPJ	10.740.670/0001-06
1.3	Data de início	28/05/2010
1.4	Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
1.5	Código ANBIMA	248975
1.6	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?	Não
1.7	Classificação tributária (CP/LP/Ações)	Previdência
1.8	Descreva o público-alvo.	Exclusivo previdenciário
1.9	O regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável à Resolução do CMN?	Este Regulamento está adequado às normas estabelecidas para os RPPS.
1.10	Conta corrente (banco, agência, nº)	0238-050-00000216/0
1.11	Conta CETIP (nº)	N/A
1.12	Administração (indique contato para informações).	Caixa Econômica Federal
1.13	Custódia (indique contato para informações).	Caixa Econômica Federal
1.14	Auditoria externa	KPMG
1.15	Caso se aplique, informar:	
	Escriturador	
	Custodiante	
	Consultor Especializado	
	Assessor Jurídico	
	Co-gestor	
	Distribuidor	
	Outros	
1.16	Cotização: abertura ou fechamento?	Fechamento

1.17	Regras para aplicação e resgate:	
	Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	17:00
	Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	
	Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	17:00
	Aplicação inicial mínima	
	Aplicação máxima por cotista	
	Resgate mínimo	
1.18	Taxa de Entrada (upfront fee)	
N/A		
1.19	Taxa de Saída (redemption fee)	
Não possui		
1.20	Taxa de administração	
0,20%		
1.21	Taxa de administração máxima	
0,20%		
1.22	Taxa de custódia máxima	
N/A		
1.23	Taxa de Performance	
	% (Percentual)	Não possui
	Benchmark	Não possui
	Frequência	Não se aplica
	Linha-d'água (sim ou não)	Não se aplica
	Método de cálculo (ativo/passivo/ajuste)	Não se aplica
1.24	Despesas do fundo pagas ao grupo econômico do administrador (e da gestora, se este for o caso) além das taxas de Administração e de Performance.	
N/A		
1.25	Há acordo de remuneração com cláusula de reversão de rebate para o fundo? (pagamento de comissão de corretagem)	
N/A		

2. Perfil

2.1	Descreva o fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento. Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.	
2.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico recente.	
N/A		
2.3	Descreva o processo decisório de investimento deste fundo de investimento.	

As decisões de alocação são tomadas em comitê, que se reúne para avaliar as tendências do mercado e as condições de investimento.

2.4

Cite as premiações, ratings e rankings dos últimos 05 anos.

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

Revista Investidor Institucional - Os Melhores Fundos para Institucionais – Nov./2013– A CAIXA conquistou o maior número de fundos excelentes.

Star Ranking Valor Econômico 2014 – 22 fundos premiados, sendo o principal critério de avaliação a relação

Revista Investidor Institucional – Top Asset – Mar./2014 – Presente no Ranking Top Asset em 18 categorias

Exame - Onde Investir em 2015 - Os Melhores Gestores – Nov./2014 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Renda

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 maio 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

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

gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset – AGO 17, realizado pela revista Inve

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./201

Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas - 2º Melhor Gestor Geral e Melhor Gestor em Fundos Ba
edição 2018 do Guia de Previdência Valor/FGV;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Março/2018) - 5 Fundos Classificad

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Agosto/2018) - 4 Fundos Classificad

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 ges
multimercados FEV/19;

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

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 317 –Agosto/2019) – CAIXA
de Gestores com 22 Fundos classificados como excelentes;

Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas – CAIXA como Gestora Destaque em Fundos Balanceado

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

Prêmio MBI/FGV – Melhor Banco para Investir - 1ª melhor gestor de fundos multimercados, 1ª melhor gesto

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 excelentes.

Valor Investe – Julho/2020 -

A CAIXA teve 3 fundos de renda fixa listados pelo Valor Investe dentre os melhores do semestre. No grupo “Renda Fixa” a CAIXA FIC Brasil Gestão Estratégica RF e o CAIXA FIC Objetivo Prefixado RF LP. No grupo “Juro Real”: CAIXA FIC Foco

Ratings Morningstar - Agosto/2020

CAIXA Alocação Macro FIC FIM LP considerado 5 estrelas no ranking

Premiação Valor – Agosto/Setembro/2020

Fundos CAIXA listados no Ranking do Guia de Fundos Valor entre os 10 fundos com melhor retorno do mercado. Macro Multimercado LP, CAIXA FIC Pré Objetivo RF LP, CAIXA FI Fidelidade RF LP, CAIXA FI Ações BDR nível I e Crédito Privado LP

Os Melhores Fundos Para Institucionais - Ranking – Revista Investidor Institucional – Agosto/Setembro

A CAIXA teve 16 fundos premiados como EXCELENTES pelo ranking “Os Melhores Fundos para Institucionais” da Revista Institucional em agosto/20.

Além do destaque positivo no Ranking Os Melhores Fundos Para Institucionais, a edição de setembro da publicação reforça a liderança CAIXA no segmento RPPS, através do Ranking TOP Asset.

3. Equipe de gestão do fundo

3.1 Cite os profissionais envolvidos na gestão

Carlos Eduardo Biteli (Gerente Nacional), Raimunda Rosandir Máximo Viana (Gerente Executivo) e Daniel Cunha Gracioso (Gerente Executivo)

3.2 Cite o histórico de alterações significativas na equipe nos últimos 05 anos.

Em 2021 foi designado como Gerente Nacional da GEFIX, o Sr. Carlos Eduardo Biteli

Em 2021 foi designado como Gerente Executivo da GEFIX, o Sr. Daniel Cunha Gracioso

4. Estratégias e carteiras

4.1 Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o fundo, em caso de

N/A

4.2 O fundo pode realizar operações de day trade?

Não.

5. Uso de derivativos

5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:	
	Proteção de carteira ou de posição	SIM X
	Mudança de remuneração/indexador	SIM X
	Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)	SIM
	Alavancagem	SIM
5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:	
	Juros	SIM X
	Câmbio	SIM
	Ações	SIM
	Commodities	SIM
	Em Bolsas:	
	Com garantia	SIM
	Sem garantia	SIM
	Em Balcão:	
	Com garantia	SIM
	Sem garantia	SIM
5.3	Qual a abordagem da gestora no investimento em ativos de crédito privado?	
	N/A	

6. Compra de cotas de fundos de investimento

6.1	De fundos de terceiros?	SIM
6.2	De fundos da gestora?	SIM

7. Informações adicionais

7.1	PL atual.
7.2	PL médio em 12 (doze) meses.
7.3	PL atual da mesma estratégia sob gestão da gestora.
7.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do fundo e de sua estratégia e critérios de definição?
N/A	
7.5	Número de cotistas.
7.6	Qual percentual do passivo do fundo representa aplicações da gestora, controladores, cotistas e seus sócios e principais executivos?
N/A	
7.7	Descreva as regras de concentração de passivo.
N/A	
7.8	Percentuais detidos pelos dez maiores cotistas.
7.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de administração fiduciária e/ou de outros prestadores de serviços durante os últimos 12 meses da operação do fundo? Quando?
Não	
7.10	A última demonstração financeira foi emitida com o parecer modificado (com ressalvas, abstenção de opinião, ênfase, parecer adverso opinião) pelo auditor independente?
Não	

8. Gestão de risco

8.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do fundo.
Conforme regulamento do Fundo	
8.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do fundo.
Conforme regulamento do Fundo	
8.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
Conforme regulamento do Fundo	
8.4	Se houver na carteira do fundo, ativos/derivativos ilíquidos/exóticos, como a gestora realiza o acompanhamento?
Conforme regulamento do Fundo	
8.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, Tracking Error)?
VaR Paramétrico	
8.6	Existem limites adicionais àqueles que constam no regulamento/regulação (por ex: concentração, emissor, contraparte, tipo de risco)? Quais?

N/A		
8.11	Qual o VaR/B-VaR/TE médio do Fundo nos últimos:	
	3 (três) meses?	4.336.230,07
	6 (seis) meses?	4.077.775,02
	12 (doze) meses?	5.698.549,65
	24 (vinte e quatro) meses?	5.150.257,09
8.12	Qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo fundo e em qual(is) (vinte e quatro) meses?	
N/A		
8.13	Qual o limite para perdas em cenário de stress? Como são definidos os cenários (ex. Utilização pela B ³ ou o próprio)?	
Cenário próprio para monitoramento, sem limite de perda estabelecido		
8.14	Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite de stress?	
N/A		
8.15	Qual o stress médio do fundo nos últimos	
	3 (três) meses?	-78.677.234,78
	6 (seis) meses?	-72.735.234,90
	12 (doze) meses?	-65.391.006,79
	24 (vinte e quatro) meses?	-89.126.787,48
8.16	Comente o último stop loss relevante do fundo.	
N/A		

9. Comportamento do fundo em crises

Período*	Evento	Comportamento (variação do fundo)	Explicação
mai/06	Crise das Bolsas norteamericanas	N/A	N/A
Jul – Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	N/A
Out/08 – Mar/09	Crise no Sistema Financeiro norteamericano	N/A	N/A
Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	N/A
Abril/11 – Set/11	Segunda crise da dívida na Europa	361.990,33	PREDI1A
Abril/15 – Ago/16	Crise política / recessão no Brasil	4.080.504,33	PREDI6M

* Para o período solicitado deve ser informado o comportamento (variação do fundo) de acordo com o mês fechado (ex. 01/01 a 31/01).

11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos

11.1	Atribuição:	Contribuição:
	N/A	N/A
11.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates)	
	N/A	
11.3	O fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação da gestora, fiduciário ou órgão regulador? Quando? Por quê?	
	Não	

12. Relacionamento com distribuidores/alocadores

12.1	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?
	Pode ser disponibilizada mensalmente.
12.2	Com que frequência é possível realizar conference calls com a gestora dos fundos?
	A qualquer momento, apenas sujeito a disponibilidade do gestor.
12.3	Por quais canais o fundo é distribuído?
	Rede agências CAIXA, Internet Banking e Mobile.
12.4	Considerando o montante total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores distribuidores/alocadores, individualmente?
	N/A

13. Atendimento aos cotistas

13.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade e defasagem?
	Boletim Comercial Disponibilizado mensalmente, informa a rentabilidade, parâmetros, histórico de rentabilidade e a defasagem de um mês. Extrato do Fundo Disponibilizado mensalmente, posição individualizada do cotista. Defasagem de um mês. Relatório de Cota Disponibilizado diariamente, caso o cotista tenha cadastrado seu endereço eletrônico previamente. Defasagem de um dia. Relatório da Carteira do Fundo Disponibilizado mensalmente, dados referente a composição dos ativos do fundo. Defasagem de um mês.
13.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e o conteúdo é atualizado?
	Página da internet e o conteúdo é atualizado sempre que necessário.
13.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado o atendimento?
	A GEICO atende diretamente os cotistas via telefone, e-mail ou pessoalmente.

14. Investimento no exterior

14.1	Qual o produto (tipo de ativo ou fundo investido) e sua estrutura, incluindo os veículos utilizados? Descreva a estratégia, os principais ativos e instrumentos utilizados.
14.2	Quais os riscos envolvidos?
14.3	Quais são os mercados em que o fundo opera?
14.4	Em relação ao veículo local, o fundo utiliza estratégias para proteção cambial?
14.5	Caso o fundo de investimento local tenha por objetivo o investimento em único fundo de investimento no exterior (fundo espelho), enumerar os prestadores de serviços e demais informações do investimento ou veículo no exterior (administrador, custodiante, RTA, prime broker, entre outros):
	Administrador Fiduciário
	Custodiante
	Auditor
	RTA
	Prime Brokers
	NAV Calculator
	Domicílio do fundo
	Taxa de administração
	Código ISIN do fundo
	Moeda do domicílio fundo no exterior
	Outros prestadores de serviço, dos investimentos no exterior, caso exista.
14.6	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação.
14.7	Caso a gestora tenha influência direta/indireta na gestão do fundo no exterior, descreva a estrutura de governança e diretoria do fundo.

15. Anexos (quando aplicável)

15	Anexos (quando aplicável)	Marcar Anexos ou link para a
15.1	Regulamento	Link de acesso
15.2	Formulário de informações complementares	Link de acesso
15.3	Última lâmina de informações essenciais	Link de acesso
15.4	Relatório de Gestão e/ou materiais de divulgação	Link de acesso