

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

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

Nome Fundo	CAIXA FI BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS			CNPJ	18.598.088/0001-50
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	C0117002	CNPJ	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	C0117002	CNPJ	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 4.604/2017:

X	Art. 7º, I, "b"	Art. 8º, I, "b"
	Art. 7º, I, "c"	Art. 8º, II, "a"
	Art. 7º, III, "a"	Art. 8º, II, "b"
	Art. 7º, III, "b"	Art. 8º, III
	Art. 7º, IV, "a"	Art. 8º, IV, "a"
	Art. 7º, IV, "b"	Art. 8º, IV, "b"
	Art. 7º, VII, "a"	Art. 8º, IV, "c"
	Art. 7º, VII, "b"	Art. 9º-A, I
	Art. 7º, VII, "c"	Art. 9º-A, II
	Art. 8º, I, "a"	Art. 9º-A, III

Identificação dos documentos analisados referentes ao Fundo:	Data do Documento	Página na internet em que o documento foi consultado ou disponibilizado pela instituição
1. Questionário Padrão Due Diligence para Fundo de Investimento – Seção 2 da ANBIMA	31/12/2019	http://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	23/08/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
3. Lâmina de Informações essenciais	-	Não Disponibilizado pela Instituição.
4. Formulário de informações complementares	31/12/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
5. Perfil Mensal	31/12/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
6. Demonstração de Desempenho	-	Não Disponibilizado pela Instituição.

7. Relatórios de Rating	-	Não Disponibilizado pela Instituição.	
8. Demonstrações Contábeis	31/12/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg	
II.5 Forma de Distribuição do Fundo (art.3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)			
Nome/Razão Social do distribuidor:	Caixa Econômica Federal		
CPF/CNPJ:	00.360.305/0001-04		
Informações sobre a Política de Distribuição:	As cotas do FUNDO são distribuídas exclusivamente pela CAIXA, que oferta ao cotista e potenciais investidores preponderantemente fundos de investimento por ela geridos. O serviço de distribuição de cotas de fundos de investimento é remunerado somente pela taxa de administração, não havendo qualquer cobrança adicional ou repasse para terceiros.		
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 referencia/objetivo de rentabilidade		
	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo – IPCA + 6,0% a.a., não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA		
Público-alvo:	Investidores Institucionais		
Condições de Investimento (Prazos/Condições para resgate)	Prazo de Duração do Fundo	3824 Dias	
	Prazo de Carência (dias)	3824	
	Prazo para Conversão de Cotas (dias)	0	
	Prazo para Pagamento dos Resgates (dias)	0	
	Prazo Total (dias)	3824	

Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada (%)		0
	Taxa de saída (%)		0
	Taxa de Administração (%)		0,20% a.a.
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d'água
	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	O desempenho do fundo de investimentos é considerado excelente, de forma que nos últimos dois anos rentabilizou 20,68%, enquanto seu benchmark rentabilizou no mesmo período 21,55%, se mostrando aderente ao seu Benchmark. O fundo possui prazo de carência até 2024, porém apresenta compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do RPPS. O Índice de Liquidez do Fundo foi obtido por meio do somatório dos índices de liquidez apurados para cada ativo ou grupo de ativos financeiros.		
Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo:	Não Houve		
Análise de fatos relevantes divulgados:	26/02/2014 - Suspensão de novas aplicações no fundo. 26/08/16 - Adequação do tipo ANBIMA.		
Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos:	O fundo se encontra aderente ao perfil da carteira e a Política de Investimentos do RPPS.		
Principais riscos associados ao Fundo:	Risco de Mercado; Risco de Crédito; Risco de Liquidez; Risco de Concentração e Risco Sistêmico e de Regulação.		

Histórico de Rentabilidade do Fundo:

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (R\$)	Valor da Cota do Fundo (R\$)	Rentabilidade (%)	Variação % do índice de referência	Contribuição em relação ao índice de referência ou desempenho do fundo como % do índice de referência
2019	38	R\$ 190.956.025,88	1,419509	Não Disponibilizado pela Instituição	Disponibilizado pela	Não Disponibilizado pela Instituição
2018	38	R\$ 183.427.955,73	1,363547	10,27%	9,95%	103,22%
2017	38	R\$ 176.072.589,49	1,30887	2,82%	9,05%	31,19%
2016	38	R\$ 171.240.588,69	1,27295	6,84%	12,64%	54,12%
2015	38	R\$ 160.276.947,60	1,19145	10,83%	17,26%	62,77%

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos		% do PL
	Títulos Públicos		100,00%
	-		-
	-		-
	-		-
	-		-

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Classificação Resolução CMN	% do PL
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
Carteira do Fundo é aderente à Política de Investimentos estabelecida em seu regulamento e com a classificação na Resolução CMN	SIM		
Prazo médio da carteira de títulos do Fundo (em meses (30) dias)	60		
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	O fundo possui prazo de carência Até dia 15/08/2024, porém apresenta compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do RPPS.		
Nota de Risco de Crédito	Agência de risco		Nota
	Não Precisa		Não Precisa
Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo analisado possui características de acordo com a Política de Investimentos do RPPS e sua compatibilidade ao perfil da carteira comparado com os demais fundos distribuídos no mercado, com os mesmo índice de Benchmark.		

Comentários Adicionais

Declaro que tenho conhecimento dos aspectos que caracterizam este Fundo de Investimento, em relação ao conteúdo de seu Regulamento e de fatos relevantes que possam contribuir para seu desempenho, além de sua compatibilidade ao perfil da carteira e à Política de Investimentos do RPPS.

Declaro que tenho conhecimento dos aspectos que caracterizam este Fundo de Investimento, em relação ao conteúdo de seu Regulamento e de fatos relevantes que possam contribuir para seu desempenho, além de sua compatibilidade ao perfil da carteira e à Política de Investimentos do RPPS.

		Data:	02/01/2020	
Responsáveis pela Análise:	Cargo	CPF	Assinatura	
Maria Oneide Moro	Diretor e Gestor de Investimentos	301.718.491-91		
JOSÉ LUIZ SILLES	Membro do Comitê de Investimentos	064.019.958-58		
JOSILENE NIZA DE SOUZA	Membro do Comitê de Investimentos	035.822.851-46		
ROBERTO CARLOS DAMBROS	Membro do Comitê de Investimentos	405.419.591-15		
DANILO VICTOR CASTILHO	Membro do Comitê de Investimentos	038.637.471.60		