

CRENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 50.569.054/0001-40 - Caixa Brasil Títulos Públicos 2033

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7, I, b

Data do Termo: 01/06/2024

Conclusão do Credenciamento: Fundo enquadrado em relação à Resolução 4963/2021.

INSTITUIÇÕES

Administrador: 00.360.305/0001-04 - Caixa Econômica Federal

Gestor: 42.040.639/0001-40 - Caixa DTVM

Art. 21º da Resolução 4963/2021: O administrador atende ao inciso I do parágrafo 2º.

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Data de Início: 05/05/2023

Índice de Referência: IPCA+5%

Carência: 16/05/2033

Prazo de Resgate: D+0

Categoria de Investidor: Geral

O Fundo/Classe possui Subclasse?: Não

Taxa de Administração: 0,15%

Taxa de Performance: Não há

Investe em cotas de outros fundos: Não

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas

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 acrescido de 5% a.a.

Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS

O fundo possui liquidez em D+0.

Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos

O fundo está em fase pré-operacional, não sendo possível analisar a composição da carteira.

Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares

O fundo objeto da análise foi comparado com 5 outros fundos, de mesmo benchmark (IPCA) e enquadramento (7, I, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,15%, ficou abaixo da média de 0,20% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de -0,47%, performou abaixo da média de 4,15%. Base de comparação:

26.507.132/0001-06 - Santander FIC Ativo Renda Fixa - Tx Adm: 0,40 - Rent 12M: 9,10
49.963.751/0001-00 - BB Previdenciário Títulos Públicos 2028 - Tx Adm: 0,15 - Rent 12M: 6,45
49.963.803/0001-30 - BB Previdenciário Títulos Públicos 2032 - Tx Adm: 0,15 - Rent 12M: 4,84
50.470.807/0001-66 - Caixa Brasil Títulos Públicos 2028 X - Tx Adm: 0,15 - Rent 12M: 0,83

Obs.: Rentabilidades com data de fechamento 31/05/2024.

Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance

O fundo busca investir em carteira composta por títulos públicos e operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais. Os ativos financeiros que compõem a carteira do fundo estarão expostos ao risco das variações das taxas de juros prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).

Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável

O resgate de cotas ocorre somente ao final do prazo de duração do fundo tendo como prazo final o dia 17/05/2033.

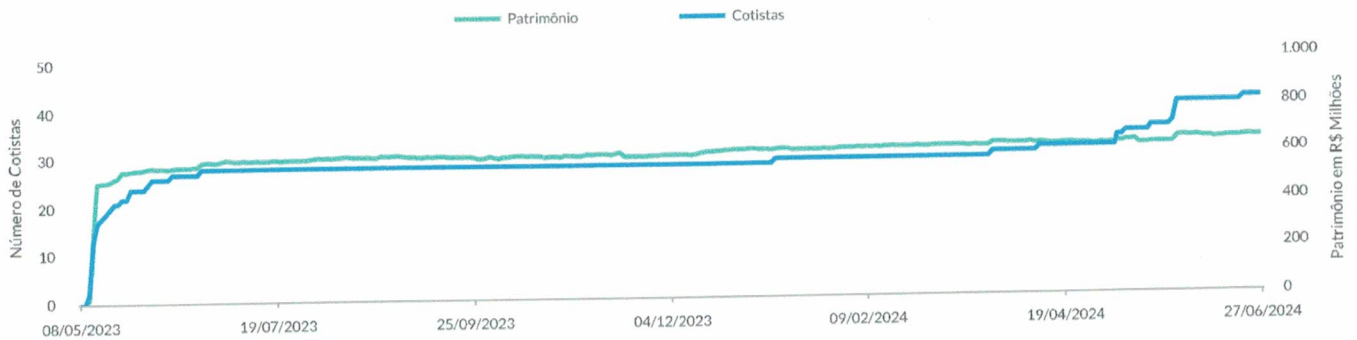
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foram observados 5 fundos da gestora 42.040.639/0001-40, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 03.737.206/0001-97, 05.164.356/0001-84, 05.164.364/0001-20, 05.114.716/0001-33, 54.518.391/0001-60. Em matéria de performance, 4 ficaram acima do benchmark.

Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN

Não se aplica.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS

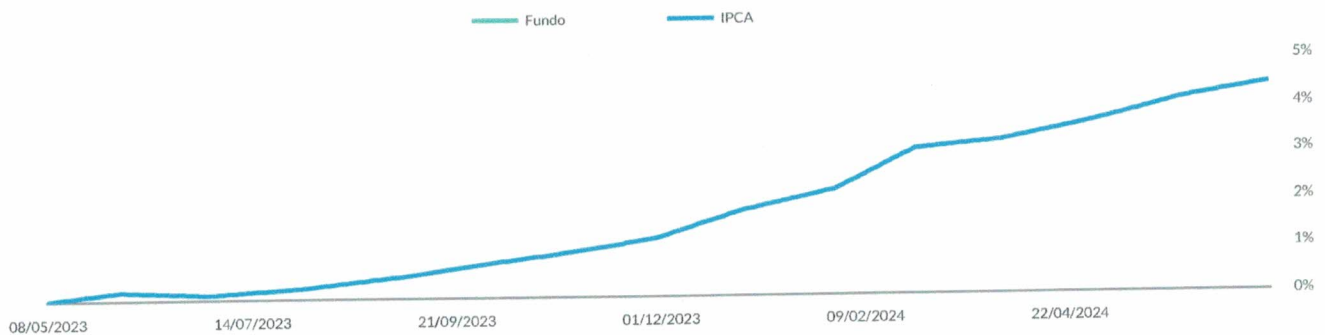


PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	651.649.679,48	41
Médio em 12 meses	615.573.713,76	30
Médio em 24 meses	601.847.421,96	29

RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-0,74	0,64	-0,29	-2,34	-1,21								-4,68
IPCA	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46								2,27
% IPCA	-175,94	77,62	-178,79	-616,20	-263,26								-206,34

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA





ATIVO	POSIÇÃO RS	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	653.001.317,94	99,61
Operações Compromissadas	2.540.419,86	0,39
Valores a receber	23.839,22	0,00
Disponibilidades	10.649,38	0,00
Valores a pagar	-29.929,70	0,00

Obs.: Informações referentes à 31/05/2024.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

Ao assinar o Credenciamento, os responsáveis atestam que:

- Possuem 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;
- Este documento não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos no fundo, 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 de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.
- Estão cientes de que a rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura, e que não há qualquer tipo de garantia, implícita ou explícita, prestada pelo emissor deste relatório e/ou empresas coligadas, ou por qualquer mecanismo de seguro, ou ainda pelo Fundo Garantidor de Crédito.

NOME	CPF	ASSINATURA
Leonor Demizol Dias	050801456-50	
Frederico dos Reis	809976546-39	
Magda de Lourdes Faria	71246680672	
Amanda Aparecida Braga	088.135.846-01	
Lucene da Luz F. Machado	249.437.448-00	