



FAZPREV
Instituto de Previdência Municipal de
Fazenda Rio Grande
CNPJ 05.145.721/0001-03

FAZPREV
Instituto de Previdência Mun.
de Fazenda Rio Grande

20 DEZ. 2017

Protocolo Nº 452/17

Responsável

INTERESSADO

NOME: Instituto de Previdência Municipal de F.R.G.

ENDEREÇO: Avenida Cedro n=507 Eucaliptos F.R.G./PR

TELEFONE (fixo): 36080954 CELULAR: _____

CARGO: _____ Local de trabalho: _____

ASSUNTO:

Aposentadoria _____ Salário Maternidade

Pensão por morte _____ Auxílio Doença

Outros BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL CNPJ 00.360.305/0001-04
ADMINISTRADORA

Data de Abertura: 20 de Dezembro / 2017 Data de Encerramento _____

Data de Reabertura: _____

ACOMPANHAMENTO

DATA	UNIDADE	RUBRICA	DATA	UNIDADE	RUBRICA

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ANÁLISE 33 E 35

2017



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

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VITER – Vice Presidência de Ativos de Terceiros

Data:

03/03/2017

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

SUMÁRIO

Versão: 2.2 - Atualizada em Mar/2017

Apresentação.....	5
1) Informações sobre a Empresa.....	6
1 - Informações Cadastrais	6



2 - Informações Institucionais	7
3 - Números da Empresa	23
4 - Receitas da Empresa.....	25
5 - Recursos Humanos	26
6 - Informações Gerais	27
7 - Informações Operacionais.....	28
8 - Compliance e Auditoria Interna	42
9 - Questões Jurídicas e Legais.....	47
10 - Anexos	47
2) Declaração	49
3) Eventos Importantes.....	50
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

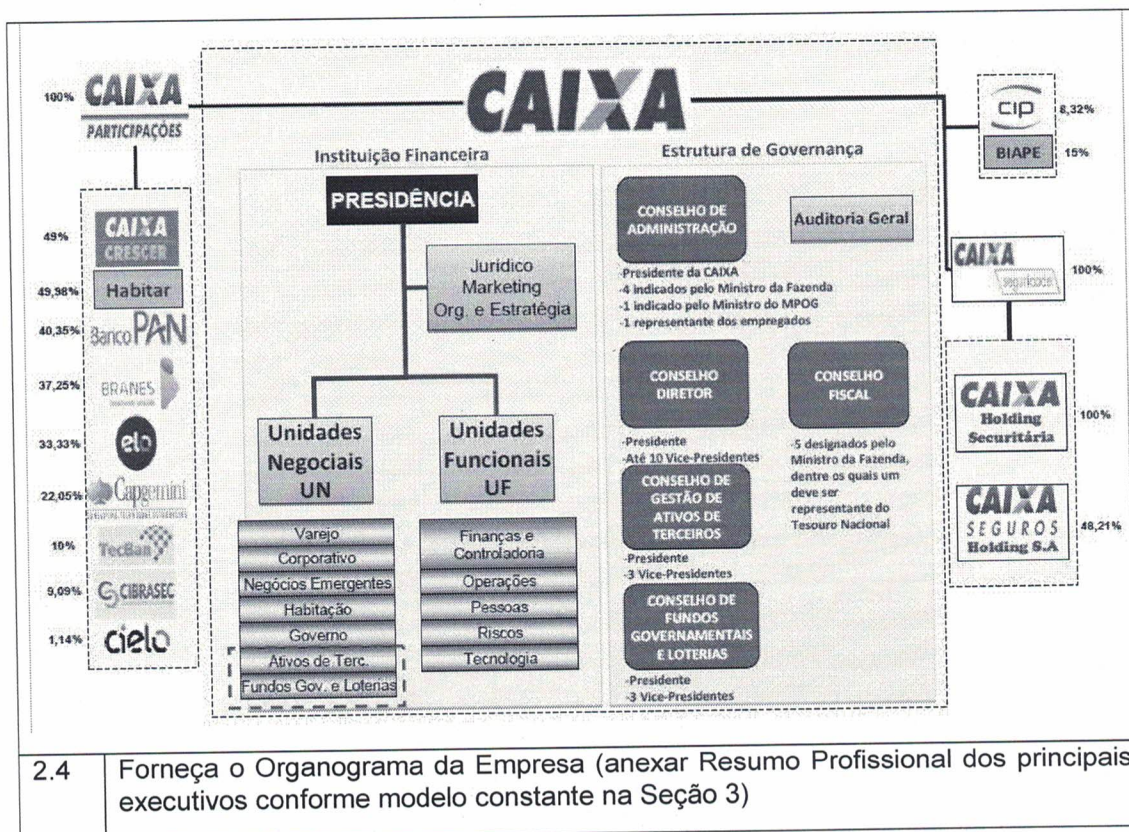
Seção 3 – Resumos Profissionais

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

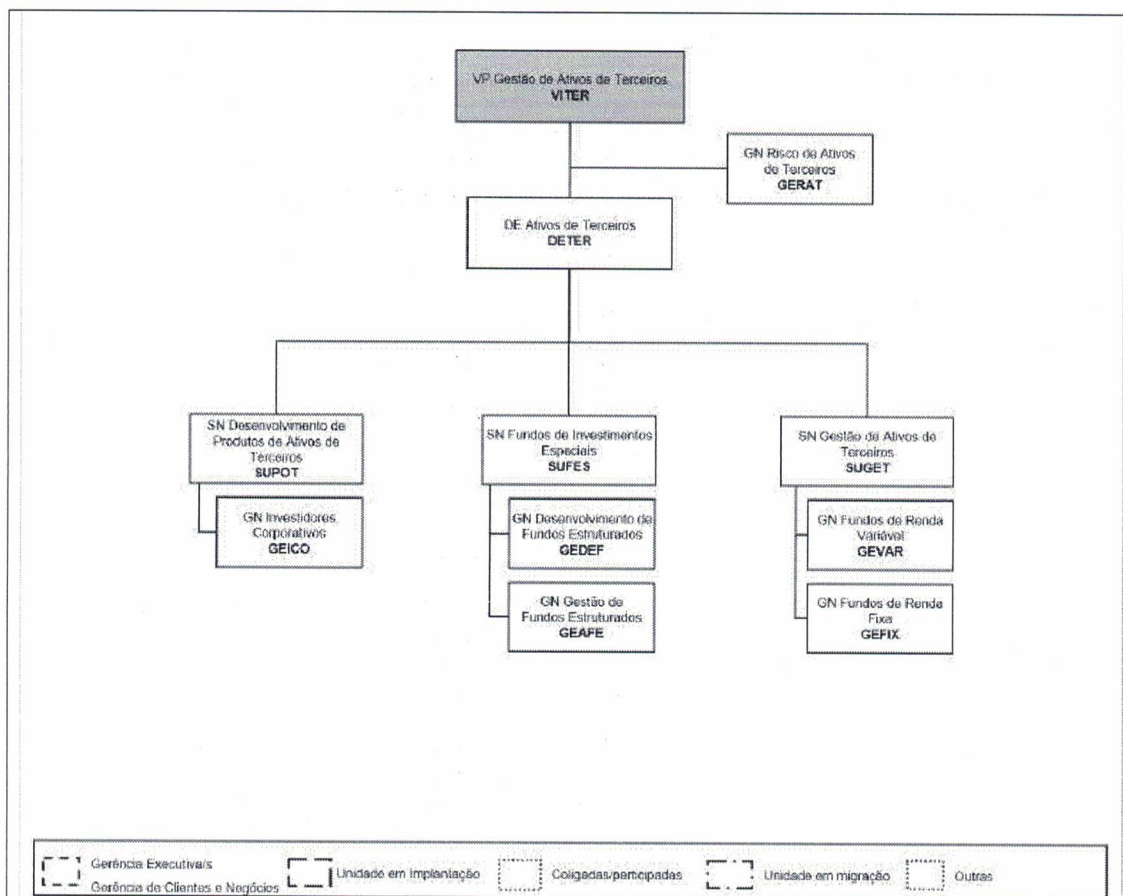
1) INFORMAÇÕES SOBRE A EMPRESA

1 - Informações Cadastrais	
1.1	Razão Social
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	
1.2	Nome de fantasia
CAIXA	
1.3	Endereço
Avenida Paulista, 2300 - 11º Andar – Bela Vista - São Paulo/SP	
1.4	CNPJ
00.360.305/0001-04	
1.5	Data de constituição
12/01/1861	
1.6	Telefone
(11) 3555-6350	
1.7	Fax
(11) 3555-9621	
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 VITER é membro da ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais e da ABVCAP – Associação Brasileira de Private Equity e Venture Capital	
1.11	Nome de quem responde o questionário
Milena Battalhini	

1.12	Cargo
	Assistente Executivo
1.13	Telefone para contato
	(11) 3572-4627
1.14	Fax
	(11)3555-9621
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 escritórios de representação no Japão, nos Estados Unidos e na Venezuela. 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?



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



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

Flávio Eduardo Arakaki- Vice-Presidente Interino de Gestão de Ativos de Terceiros (VITER)

- Mestre em Administração de Empresas pelo Instituto de Ensino e Pesquisa – INSPER, pós graduado em Fundos de Investimentos pela PUC/SP, especialização em Engenharia Econômica pela Universidade Presbiteriana Mackenzie, graduado em Administração de Empresas pela Universidade Presbiteriana Mackenzie.

- Na CAIXA desde 1999, atuou nas áreas de crédito empresarial e, desde 2001, nas atividades da área de Fundos de Investimentos. Durante sua atuação na área de Fundos de Investimento já exerceu cargos nas áreas de Renda Variável, Estudos e Cenários Econômicos, Pesquisas Quantitativas, Gestão e Administração de Fundos de Investimentos Estruturados (FII, FIDC e FIP).

- Atualmente é Diretor Executivo da Diretoria Executiva de Ativos de Terceiros – DETER, sendo responsável pelas áreas de Gestão, Administração e Distribuição de Fundos de Investimentos de Varejo, Exclusivos, Estruturados, bem como Carteiras Administradas do FGTS, Carteiras Comerciais e Carteiras de Prefeituras e dos Regimes Próprios de Previdência..

2.6	A empresa é signatária do Código de Regulação e Melhores Práticas da ANBIMA? Em caso afirmativo, citar o(s) Código(s).
<p>Sim. A CAIXA é signatária dos seguintes Códigos da ANBIMA:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Código ABVCAP/ANBIMA FIP e FIEE - Código de Distribuição de Produtos no Varejo - Código de Ética - Código de Negociação de Instrumentos Financeiros - Código dos Processos da Regulação e Melhores Práticas - Código para Fundos de Investimento - Código para Fundos de Investimento – categoria Distribuidor - Código para o Programa de Certificação Continuada - Código para Serviços Qualificados ao Mercado de Capitais. 	
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?
<p>Sim. Comitê de Fundos de Renda Fixa e Multimercados, Fundos de Ações, Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios, Fundos de Investimento em Participações e Fundos Estruturados da ANBIMA.</p> <p>Alguns executivos também participam de Conselhos em companhias investidas pelos fundos.</p>	
2.11	Descreva breve histórico da empresa.
Desde que foi criada, em 1861, a Caixa sempre buscou ser mais que apenas um banco, mas uma instituição realmente presente na vida de milhões de brasileiros. Ela é, por exemplo, o agente responsável pelo Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS), pelo Programa	

de Integração Social (PIS) e pelo Seguro-Desemprego, institutos tão presentes na vida do trabalhador formal. Aparece ainda no momento de ajudar a população, através dos programas sociais do governo, como o Bolsa Família – que beneficia mais de 13 milhões de brasileiros, FIES e Programa Minha Casa Minha Vida.

Quando falamos que ela está presente sempre e em qualquer lugar é em qualquer lugar mesmo. Tanto é que é o único banco que tem duas agências-barco – e está construindo a terceira – que levam acesso, desenvolvimento e cidadania para as populações ribeirinhas. Falando em acesso, desde 2004 a Caixa patrocina o esporte paralímpico e possui ainda mais de 4.000 funcionários treinados em libras. É mais uma vez a Caixa reforçando o seu compromisso em ser um banco para todos os brasileiros, promovendo a inclusão e trabalhando sempre para atender com a mesma atenção e eficiência todos os cidadãos.

A Caixa é uma empresa 100% pública, e que exerce um papel fundamental no desenvolvimento urbano e da justiça social do país, vez que prioriza setores como habitação, saneamento básico, infraestrutura e prestação de serviços, contribuindo significativamente para melhorar a vida das pessoas, principalmente as de baixa renda. Além disso, ela apoia inúmeras atividades artísticas-culturais, educacionais e desportivas, garantindo um lugar de destaque no dia a dia das pessoas, pois acredita que pode fazer o melhor pelo país e por cada um de seus habitantes.

Para seus correntistas, a Caixa busca sempre oferecer os melhores serviços e opções de crédito, ajudando-os a concretizar seus sonhos, acumulando conquistas e sucessos em parceria com o povo brasileiro. Só um banco com a tradição e conhecimento da Caixa para ser a poupança dos brasileiros há mais de 150 anos, e com muitos ainda por vir. 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 <i>Suitability</i> . 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.
------	---

Tem por finalidade analisar, definir, planejar, aprovar produtos, políticas e estratégias, gestão de risco e conformidade. As reuniões ordinárias ocorrem mensalmente. É composto por nove membros titulares, a saber:

- _ Vice-Presidente da VITER;
- _ Diretor Executivo de Ativos de Terceiros
- _ Superintendente Nacional da SUFES;
- _ Superintendente Nacional da SUGET;

- _ Superintendente Nacional da SUPOT;
- _ Gerente Nacional da GEICO;
- _ Gerente Nacional da GERAT;
- _ Consultores de Dirigente da VITER.

COMITE DE INVESTIMENTO

Tem por finalidade analisar e aprovar políticas e estratégias de alocação de portfólio dos fundos de investimento e carteiras administradas. As reuniões ordinárias ocorrem mensalmente. É composto por oito membros titulares, a saber:

- _ Superintendente Nacional da SUGET;
- _ Gerente Nacional da GEFIX;
- _ Gerentes Executivos da GEFIX;
- _ Gerente Nacional da GEVAR;
- _ Gerentes Executivos da GEVAR.

COMITE DE INVESTIMENTO PARA FUNDOS DE FUNDOS (FOF)

Tem por finalidade avaliar e aprovar políticas e estratégias de alocação em fundos geridos por outras instituições. As reuniões ordinárias ocorrem mensalmente. O Comitê é composto por seis membros titulares, a saber:

- _ Vice Presidente da VITER;
- _ Diretor Executivo da DETER;
- _ Superintendente Nacional da SUGET;
- _ Gerente Nacional da GEVAR;
- _ Gerente Nacional da GEFIX;
- _ Gerente Executivo da GEVAR, responsável pela gestão dos fundos multigestores.

COMITE TÁTICO OPERACIONAL

Tendo por finalidade examinar e avaliar, diariamente, o cenário dos mercados financeiro e de capitais objetivando realizar as operações de compra e venda de ativos para os fundos de investimento e carteiras administradas, e definir as estratégias para participação em leilões de títulos públicos. As reuniões ordinárias do Comitê ocorrem diariamente, precedendo a abertura dos mercados. O Comitê é composto por sete membros titulares, a saber:

- _ Gerente Nacional de Renda Fixa – GEFIX;
- _ Gerente Nacional de Renda Variável – GEVAR;
- _ Gerentes Executivos da GEFIX;
- _ Gerentes Executivos da GEVAR

COMITE DE PRODUTOS

Tem por finalidade analisar o movimento da indústria de fundos, a viabilidade dos produtos, com base nos resultados de pesquisas mercadológicas e propor ao Comitê de Planejamento e Gestão a adequação do portfólio de produtos em consonância com as estratégias da CAIXA. As reuniões ordinárias ocorrem mensalmente. O Comitê é composto por seis membros titulares, a saber:

- _ Superintendente Nacional da SUPOT;
- _ Gerente Executivo da SUPOT;
- _ Gerente Nacional da GEICO;
- _ Um dos Gerentes Nacionais da SUGET, responsável pela Área a qual o produto se refere, Renda Fixa (GEFIX) e/ou Renda Variável (GEVAR);
- _ Gerente Executivo da GERAT, responsável pelo Risco;

COMITE DE PRODUTOS DE FUNDOS ESPECIAIS

Tem por finalidade analisar o movimento da indústria de fundos e a viabilidade dos produtos, com base nos resultados de pesquisas mercadológicas, propor a adequação do portfólio de fundos especiais e estruturados. As reuniões ordinárias ocorrem mensalmente. O Comitê é composto por seis membros titulares, a saber:

- _ Superintendente Nacional da SUFES;
- _ Gerente Nacional da GEDEF;

- _ Gerente Nacional da GEAFE;
- _ Gerente Nacional da GERAT;
- _ Gerente Nacional da GEICO;

COMITE DE GESTÃO DE FUNDOS ESPECIAIS

Tem por finalidade aprovar políticas e estratégias de alocação de ativos dos fundos especiais e estruturados. As reuniões ordinárias ocorrem mensalmente. O Comitê é composto por seis membros titulares, a saber:

- _ Vice Presidente da VITER;
- _ Diretor Executivo da DETER;
- _ Superintendente Nacional da SUFES;
- _ Gerente Nacional da GEDEF;
- _ Gerente Nacional da GEAFE;

COMITE DE RISCOS

Tem por finalidade analisar, acompanhar, propor limites e procedimentos para riscos de crédito, liquidez e mercado de fundos, nos fundos de investimento e carteiras administradas. As reuniões ordinárias ocorrem bimestralmente. O Comitê é composto por oito membros titulares, a saber:

- _ Diretor Executivo da VITER;
- _ Gerente Nacional da GERAT;
- _ Gerente Nacional da GEFIX;
- _ Gerente Nacional da GEVAR;
- _ Gerente Nacional da GEICO;
- _ Gerente Executivo da GERAT, responsável pelo Risco;
- _ Um Consultor de Dirigente da VITER.

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 VITER – Vice Presidência de Ativos de Terceiros.

Dentro da VITER as atividades de administração são efetuadas pela SUPOT – Superintendência Nacional de Desenvolvimento de Produtos para Ativos de Terceiros e, no caso de fundos especiais, pela SUFES – Superintendência Nacional de Fundos de Investimentos Especiais.

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 de Fundos de Investimentos Especiais.

Já os serviços de custódia e controladoria são prestados através de outra vice-presidência, a VIOPE - Vice Presidência de Operações Corporativas por intermédio da SUBAN – Superintendência Nacional de Processos Bancários:

ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO

SUPOT – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DESENVOLVIMENTO DE PRODUTOS ATIVOS DE TERCEIROS

- Produtos para ativos de terceiros.
- Prestação de serviços de administração fiduciária.

SUFES – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESPECIAIS

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

SUGET – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO ATIVOS DE TERCEIROS

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

CUSTÓDIA E CONTROLADORIA

SUBAN – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL PROCESSOS BANCÁRIOS

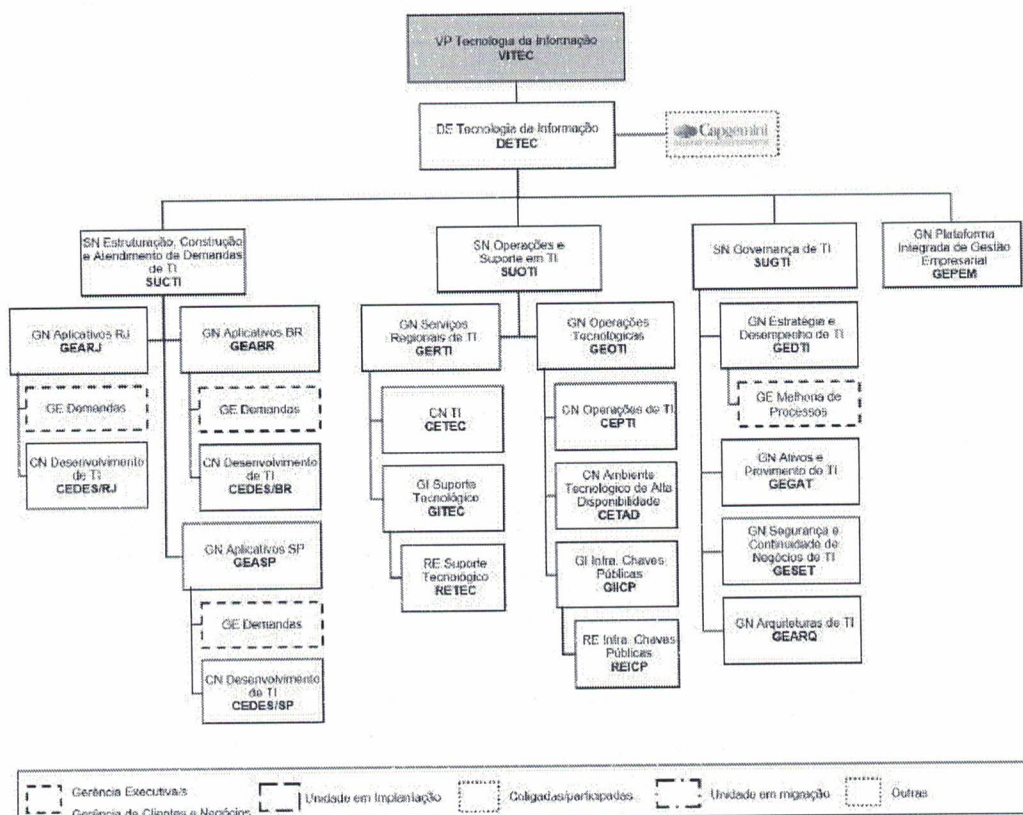
- Soluções que garantam o processamento bancário adequado às necessidades da CAIXA.

GELIT – GERÊNCIA NACIONAL LIQUIDAÇÃO E CUSTÓDIA

- Liquidação de operações financeiras.
- Back-office de câmbio.
- Custódia de títulos.
- Serviços de controladoria de ativos e passivos.
- Serviços de custódia qualificada.

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 de Tecnologia da Informação.



VITEC – VICE PRESIDÊNCIA DE TECNOLOGIA DA INFORMAÇÃO

Construção, manutenção e disponibilização de soluções de Tecnologia da Informação e Comunicação (TIC) para sustentar as atividades de negócio e funcionais da CAIXA.

GEPEM – GERÊNCIA NACIONAL PLATAFORMA INTEGRADA DE GESTÃO EMPRESARIAL

- Implantação de Solução ERP

SUCTI – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL ESTRUTURAÇÃO, CONSTRUÇÃO E ARQUITETURA DE SOLUÇÕES DE TI

- Desenvolvimento e manutenção de soluções de TI.

- Demandas para a TI.

GESOL – GERÊNCIA NACIONAL ARQUITETURA DE SOLUÇÕES E INTEGRAÇÃO

- Arquitetura, metodologias, padrões e ferramentas para desenvolvimento de aplicativos.

- Prospecção de soluções de mercado.

GEMOD – GERÊNCIA NACIONAL MODELOS E CONTRATOS DE DESENVOLVIMENTO EM TI

- Modelo de contratação para desenvolvimento de soluções de TI.

- Padrões para demandas de TI.

GEABR – GERÊNCIA NACIONAL APLICATIVOS – BR

- Desenvolvimento e manutenção de soluções e projetos voltados para Crédito, Administração Financeira, Gestão Corporativa, Habitação e Portais Intranet, Internet e Extranet.

CEDES/BR – CENTRALIZADORA NACIONAL DESENVOLVIMENTO DE TI – BRASÍLIA

- Desenvolvimento de soluções do âmbito da GEABR.

GEARJ – GERÊNCIA NACIONAL APLICATIVOS – RJ

- Desenvolvimento e manutenção de soluções e projetos voltados para Fundos e Programas de Governo, Programas Sociais, Cadastro de Clientes e Fomento.

CEDES/RJ – CENTRALIZADORA NACIONAL DESENVOLVIMENTO DE TI – RIO DE JANEIRO

- Desenvolvimento de soluções do âmbito da GEARJ.

GEASP – GERÊNCIA NACIONAL APLICATIVOS – SP

- Desenvolvimento e manutenção de soluções e projetos voltados para Canais de Atendimento, Automação Bancária, Serviços Comerciais, Mercado Financeiro e Segmento Judiciário.

CEDES/SP – CENTRALIZADORA NACIONAL DESENVOLVIMENTO DE TI – SÃO PAULO

- Desenvolvimento de soluções do âmbito da GEASP.

SUOTI – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL OPERAÇÕES E SUPORTE EM TI

- Operação da infraestrutura de TIC.
- Processamento, disponibilização e armazenamento das soluções de TI e seus dados.

- Prospecção e homologação de hardware e software.

GEART – GERÊNCIA NACIONAL ARQUITETURA TECNOLÓGICA E INTEGRAÇÃO

- Prospecção e homologação de hardwares e softwares.
- Planejamento e administração da infraestrutura tecnológica.

GEOTI – GERÊNCIA NACIONAL OPERAÇÕES TECNOLÓGICAS

- Processamento, disponibilização de informações e armazenamento das soluções de TI nos ambientes centralizado, de alta disponibilidade e de certificação digital.
- Processos de serviços de TI.
- Nível de serviço de TI no ambiente centralizado.
- Telecomunicações na CAIXA.
- Plano de contingência operacional dos sistemas do ambiente centralizado de TI e alta disponibilidade.

CEPTI – CENTRALIZADORA NACIONAL OPERAÇÕES DE TI (SP/RJ/BR)

- Processamento, disponibilização e armazenamento das soluções de TI.
- Ambiente de homologação (HMP).
- Segurança física e lógica da informação.
- Níveis de serviços tecnológicos acordados.
- Telecomunicações no ambiente centralizado.
- Plano de contingência operacional dos sistemas do ambiente centralizado de TI e alta disponibilidade de TI

CETAD- CENTRALIZADORA NACIONAL AMBIENTE TECNOLÓGICO DE ALTA DISPONIBILIDADE

- Processamento, disponibilização e armazenamento das soluções de TI com alto nível de disponibilidade.

- Telecomunicações no ambiente de alta disponibilidade de TI.

GIICP – GERÊNCIA DE FILIAL INFRAESTRUTURA DE CHAVES PÚBLICAS

- Disponibilização e armazenamento das soluções de TI do ambiente de Certificação Digital.

REICP – REPRESENTAÇÃO DE FILIAL INFRAESTRUTURA DE CHAVES PÚBLICAS

- Atuação como braço operacional que demandam presença física junto ao negócio,

GERTI – GERÊNCIA NACIONAL SERVIÇOS REGIONAIS DE TI

- Processos e rotinas de TIC no ambiente descentralizado.
- Suporte, infraestrutura tecnológica e disponibilidade de canais.
- Nível de serviço de TI no ambiente descentralizado.

CETEC – CENTRALIZADORA NACIONAL DE TECNOLOGIA DA INFORMAÇÃO

- Suporte para o ambiente descentralizado.
- Inventário de recursos no ambiente descentralizado.
- Desenvolvimento e produção de soluções no ambiente descentralizado.
- Gestão de incidentes e mudanças no ambiente descentralizado.

GITEC – GERÊNCIA DE FILIAL DE SUPORTE TECNOLÓGICO

- Gestão de incidentes, desenvolvimento de soluções e serviços tecnológicos de software, hardware e comunicação no ambiente descentralizado e externo.

- Suporte tecnológico para canas e unidades da CAIXA.

RETEC – REPRESENTAÇÃO DE FILIAL DE SUPORTE TECNOLÓGICO

- Atuação como braço operacional que demandam presença física junto ao negócio,

SUGTI – SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL GOVERNANÇA DE TI

- Governança da TI.

- Estratégia de TI.

- Segurança de TI e Continuidade de Negócios.

- Orçamento de TI

- Provimento de ativos de TI.

- Gestão operacional da Participação estratégica de TI – CPMBraxis Capgemini.

GEDTI – GERÊNCIA NACIONAL ESTRATÉGIA E DESEMPENHO DE TI

- Estratégia, comunicação e desempenho de TI

- Portfólio de projetos de TI.

GEGAT – GERÊNCIA NACIONAL ATIVOS E PROVIMENTO DE TI

- Planejamento financeiro e orçamentário da TI.

- Apuração de custos de TI

- Provimento de ativos de TI.

GESET – GERÊNCIA NACIONAL SEGURANÇA E CONTINUIDADE DE NEGÓCIOS DE TI

- Segurança, acesso lógico e continuidade de TI.

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 sob gestão
2012	310.494.056.264,64	191	309
2013	336.529.501.543,84	210	343
2014	358.719.154.424,09	219	337
2015	401.543.548.369,77	215	345
2016	422.415.267.888,75	185	312

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

	Nº	% Carteira
• Fundos:	289	63,62%
Domicílio local	0	
Domicílio em outro país		
• Clubes	0	

<ul style="list-style-type: none"> • Carteiras <p>Domicílio local</p> <ul style="list-style-type: none"> • Res. Nº 2.689 	23	36,38%	
3.3	Como os ativos sob gestão estão divididos conforme as seguintes categorias de fundos de investimento?		
Tipo	Nº	Exclusivos	% total
• Curto Prazo	0	0	0
• Referenciado	0	0	0
• Cambial	2	1	0,02
• Renda Fixa	185	83	47,14
• Multimercado	47	19	2,65
• Dívida Externa	0	0	0
• Ações	27	2	2,53
• FIDC	4	3	0,45
• FIP	13	13	8,96
• FIEE	0	0	0
• FII	9	7	1,85
• Fundo de Índice (ETF)	2	0	0,02
• Outras categorias	23	23	36,38
3.4	Com quantos distribuidores e/ou alocadores a Empresa tem acordos ou contratos de distribuição?		
nº 01			
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)?		

2,03% (dados de 03/2016)		
3.7	Qual a distribuição do passivo segundo tipologia de investidor?	
	Tipo	nº % passivo
	• Pessoas Físicas	785.131 10,81
	• Empresas	233.789 63,05
	• Instituições Financeiras/ Seguradoras/ Soc. de Capitalização	33 0,13
	• Investidores Institucionais Previdenciários	38 8,69
	• Distribuidores, Alocadores (inclui fundos de fundos de terceiros e <i>family offices</i>)	0 0
	• Investidor Estrangeiro	0 0
	• Governo	14.631 17,32
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 50,46%	
	1	45,50%
	2	1,20%
	3	0,88%
	4	0,71%
	5	0,63%
	6	0,43%
	7	0,32%
	8	0,28%
	9	0,27%
	10	0,26%
4 - Receitas da Empresa		
4.1	Qual a estrutura de receitas da Empresa? (gestão, performance, comissões, rebates etc.)	

A receita da VITER provém de taxa de Gestão, distribuição, administração, estruturação e performance	
4.2	Qual parcela do resultado da Empresa vem da atividade de gestão de carteiras?
9,17% Referente à RPS 3º Tri 2016.	
4.3	A receita de Taxa de Administração é suficiente para cobrir os custos da Empresa?
Sim, é suficiente para cobrir os gastos da VITER.	
5 - Recursos Humanos	
5.1	Quais as regras de remuneração ou comissionamento dos funcionários e associados?
<p>Os funcionários recebem além da remuneração fixa, participação nos lucros e premiação em clubes de compras.</p> <p>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.</p>	
5.2	Quais são os mecanismos de retenção de talentos usados pela Empresa?
<p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>Atuando em todo território nacional e em diferenciados segmentos a CAIXA disponibiliza</p>	

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).	
6 - Informações Gerais	
6.1	Qual o limite para o crescimento dos ativos sob gestão suportado pela atual estrutura da Empresa (instalações, equipe, <i>hardware</i> e <i>software</i>)? Existem planos de expansão?
Em 2014, a VITER expandiu suas instalações para atender o crescimento de suas unidades e atividades. 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 <i>rating</i> ? Qual a nota atribuída à gestão? (anexar relatório mais recente)
Sim. Em março de 2016 foi reafirmado o conceito "Mais Alto Padrão" atribuído pela FITCH Ratings, atestando a sua excelência em qualidade de gestão (melhor rating da escala)	
6.3	A empresa já recebeu alguma premiação por publicações ou entidades no que tange à qualidade e ao histórico de gestão? Quais?
<p>Guia Exame 2010 - Melhor gestor de fundos de varejo e melhor gestor de fundos de renda fixa ativa.</p> <p>Guia Exame 2011 - 2º melhor gestor de fundos de varejo e 3º melhor gestor de fundos de renda fixa ativa.</p> <p>Star Ranking Valor Econômico 2013 – 22 fundos premiados, sendo o principal critério de avaliação a relação risco x retorno.</p> <p>Revista Investidor Institucional - Os Melhores Fundos para Institucionais – Nov./2013– A CAIXA conquistou o topo do ranking com o maior número de fundos excelentes.</p> <p>Star Ranking Valor Econômico 2014 – 22 fundos premiados, sendo o principal critério de avaliação a relação risco x retorno.</p> <p>Revista Investidor Institucional – Top Asset – Mar./2014 – Presente no Ranking Top Asset em 18 categorias do ranking</p> <p>Exame - Onde Investir em 2015 - Os Melhores Gestores – Nov./2014 - 2º Melhor Gestor de</p>	

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.

Revista Investidor Institucional – Ranking Top Asset – Ago./2016– A CAIXA conquistou o topo do ranking em quatro categorias:

- *Maior Gestor de Carteiras Administradas;*
- *Maior Gestor de FIPs;*
- *Maior Gestor de RPPS;*
- *Maior Gestor Governos/Fundos Públicos*

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 equipe é composta por seis profissionais, sendo um gerente executivo, um coordenador, três técnicos de análise econômica e um técnico responsável 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 Agosto de 2012 houve a alteração do Gerente Executivo da área. Em 2016, em virtude de um processo de reestruturação a área perdeu dois analistas ligados à atividade de pesquisa de empresas.

7.1.3 | Utiliza *research* próprio ou de terceiros? Em que proporções?

No que se refere à análise econômica, cerca de 80% do material é produzido internamente. Nesse percentual está incluso a cobertura da Economia Brasileira, Americana e Zona do Euro e China. Os 20% restantes referem-se à *research* de terceiros relacionados à economia internacional. Do ponto de vista da análise setorial, cerca de 10% do material é produzidos internamente, com destaque para a cobertura do setor de construção civil. O complemento toma como base material externo referente aos demais setores.

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 (<i>sell side</i>)?
	No que se refere à pesquisa econômica, o processo decisório inclui a análise de séries históricas, modelos econômicos e projeções destes derivados. 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. À partir destas ferramentas são produzidos relatórios internos de estudo e análise. A equipe de Research tem dedicação exclusiva para o atendimento interno.
7.1.5	Que serviços ou sistemas são contratados para apoio na análise?
	São contratadas consultorias setoriais, econômica e política, 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 VITER 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 Gerências GEAFE destinadas à Gestão de seus FIDCs, FIPs e FIIs. (Conforme organograma do item 2.4).
7.2.2	Principais mudanças na equipe de gestão nos últimos cinco anos.
	Nos últimos 05 anos a equipe de Gestão cresceu em virtude do aumento de número de Fundos e de atividades. A equipe de Gestão de Fundos Estruturados iniciou suas atividades por meio de uma Gerência Executiva composta por cerca de 10 empregados e atualmente tornou-se uma Superintendência, composta por cerca de 80 empregados, dos quais cerca de 60 fazem parte da equipe de Fundos Estruturados. Em 2014, houve substituição do Gerente Nacional da GEVAR – Gestão em Renda Variável. Em 2015, houve a substituição do Superintendente da SUGET.
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).	
7.2.4	Qual o processo de seleção e acompanhamento das corretoras?
<p>O processo de seleção e contratação de corretoras é realizado com base em manual operacional específico. Para operar nos mercados BOVESPA e BM&F o processo de seleção envolve a avaliação da qualidade do atendimento prestado, qualidade operacional dos serviços prestados à VITER e qualidade dos estudos e relatórios econômicos produzidos, mediante a atribuição de notas pelas equipes técnicas das áreas envolvidas, ponderadas para o cálculo da nota final e definição de ranking dos prestadores de serviço.</p> <p>São selecionadas para operar a cada semestre civil doze instituições para cada mercado, BOVESPA e BM&F.</p>	
7.2.5	Liste as corretoras aprovadas.
<p>Mercados BOVESPA</p> <p>ATIVA</p> <p>BGC LIQUIDEZ DTVM</p> <p>BRADESCO</p> <p>BTG PACTUAL CTVM S/A</p> <p>COINVALORES</p> <p>CONCÓRDIA</p> <p>CREDIT SUISSE</p> <p>RENASCENÇA</p> <p>SAFRA</p> <p>SANTANDER</p> <p>UBS BRASIL CCTVM S.A.</p> <p>XP INVESTIMENTOS</p> <p>Mercados BM&F</p> <p>ATIVA</p> <p>BGC LIQUIDEZ DTVM</p> <p>BRADESCO</p> <p>BTG PACTUAL CTVM S/A</p>	

CAPITAL MARKETS	
CREDIT SUISSE	
RENASCENÇA	
SANTANDER	
TULLETT PREBON	
UBS BRASIL CCTVM S.A.	
VOTORANTIM	
XP INVESTIMENTOS	
7.2.6	Que critérios orientam a divisão de ordens entre as corretoras selecionadas? Comente concentração, rodízio e o uso de <i>discount brokers</i> e <i>research brokers</i> .
<p>A distribuição do volume operado nos Mercados BM&F é:</p> <p>Para as corretoras do ranking research ocupantes do 1°, 2°, 3° e 4° lugares, são destinados 40% da corretagem total paga no período operacional estipulado, respeitando-se a proporção individual de 10%;</p> <p>Para as corretoras do ranking research ocupantes do 5° e 6° lugares e para as corretoras do ranking discount ocupantes do 1° e 2° lugares, são destinados 33% da corretagem total paga no período operacional estipulado, respeitando-se a proporção individual de 8,25%;</p> <p>Para as corretoras do ranking discount ocupantes do 3°, 4°, 5° e 6° lugares, são destinados 27% da corretagem total paga no período operacional estipulado, respeitando-se a proporção individual de 6,75%.</p> <p>A distribuição do volume operado nos Mercados BOVESPA é:</p> <p>Para as corretoras do ranking de research ocupantes do 1°, 2°, 3° e 4° lugar, são destinados 40%, respeitando-se a proporção individual de 10%;</p> <p>Para as corretoras do ranking de research ocupantes do 5° e 6° lugar e para as corretoras do ranking de discount ocupantes do 1° e 2° lugar, são destinados 33%, respeitando-se a proporção individual de 8,25%;</p> <p>Para as corretoras do ranking discount ocupantes do 3°, 4°, 5° e 6° lugar, são destinados 27%, respeitando-se a proporção individual de 6,75%.</p> <p>Em relação ao rodízio de instituições intermediadoras, no encerramento de cada semestre civil, ocorre a reavaliação das corretoras/distribuidoras:</p>	

Operações nos Mercados BOVESPA

O processo de seleção de corretoras para o mercado BOVESPA é realizado semestralmente com a seleção de 12 corretoras para operar no período, sendo as 06 (seis) primeiras classificadas do ranking da categoria research e as 06 (seis) primeiras classificadas do ranking da categoria discount.

Na categoria research, são excluídas do processo de seleção para o período seguinte as duas corretoras/distribuidoras operantes pior avaliadas.

Na categoria discount, são excluídas do processo de seleção para o período seguinte, as duas corretoras/distribuidoras operantes pior avaliadas.

As corretoras/distribuidoras excluídas do processo seletivo nos termos dos itens anteriores, no período considerado, voltam a ser reavaliadas no período seguinte.

Às corretoras/distribuidoras remanescentes, são adicionadas as corretoras/distribuidoras não operantes no período, sendo formado um novo grupo a ser avaliado, dividido nas duas categorias existentes.

Após a apuração das notas do novo grupo formado, são selecionadas para o período seguinte as seis corretoras/distribuidoras da categoria research melhor avaliadas e as seis corretoras/distribuidoras da categoria discount melhor avaliadas.

Operações nos Mercados BM&F

A cada semestre são selecionadas para operar no Mercado BM&F 12 (doze) instituições, incluída neste obrigatoriamente a instituição atuante como agente centralizador de custódia e liquidação.

O processo de seleção ocorre em três etapas, sendo destinadas respectivamente: à qualidade do atendimento prestado, qualidade operacional dos serviços prestados à CAIXA e qualidade dos estudos e relatórios econômicos.

No encerramento de cada semestre, as corretoras/distribuidoras operantes são reavaliadas de forma segmentada, nas categorias research e discount.

Na categoria research, são excluídas do processo de seleção para o semestre seguinte, as duas corretora/distribuidora operante pior avaliada.

Na categoria discount, são excluídas do processo de seleção para o semestre seguinte, as duas corretoras/distribuidoras operantes pior avaliadas.

A exclusão a que se refere os itens anteriores não se aplicam à corretora/distribuidora atuante como agente centralizador de custódia e liquidação.

Neste caso, é excluída do processo a corretora/distribuidora com a classificação imediatamente

anterior.	
As corretoras/distribuidoras excluídas do processo seletivo nos termos dos itens mencionados anteriormente, no período considerado, voltam a ser reavaliadas no período seguinte.	
Às corretoras/distribuidoras remanescentes, são adicionadas as corretoras/distribuidoras não operantes no semestre, sendo formado um novo grupo a ser avaliado, dividido nas duas categorias existentes.	
Após a apuração das notas do novo grupo formado, são selecionadas para o período seguinte as seis corretoras/distribuidoras da categoria research melhor avaliadas e as seis corretoras/distribuidoras da categoria discount melhor avaliadas, ocupando as seis primeiras colocações as corretoras melhor avaliadas da categoria research, e em seguida as seis corretoras melhor avaliadas da categoria discount.	
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?
O desempenho dos gestores é avaliado de maneira absoluta, comparando o resultado dos fundos contra seus objetivos, e de maneira relativa, por meio de rankings elaborados por clientes exclusivos, ou em comparação com fundos semelhantes nas maiores instituições.	
7.2.1	A quem os gestores prestam conta da performance dos fundos?
0	
Os gestores prestam conta mensalmente ao Vice Presidente da área, além da prestação de conta com os clientes de fundos exclusivos conforme demanda.	
7.3 – Risco	
7.3.1 – Estrutura	
7.3.1.	Descreva a estrutura de gerenciamento de riscos da empresa (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3)
1	
A VITER possui uma Gerência Nacional de Risco e Conformidade - GERAT, vinculada diretamente à vice-presidência, responsável pelo controle, monitoramento e gerenciamento dos riscos dos	

<p>fundos de investimento sob administração da CAIXA. Conta com 01 Gerente Executivo e 05 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 VITER.</p>	
7.3.1. 2	<p>Quem é o responsável pela área e a quem se reporta?</p>
<p>O responsável pela Gerência Nacional de Risco de Ativos de Terceiros é o Gerente Nacional, Sr. Alessandro Toledo Cruzolini. O referido profissional reporta-se diretamente ao Vice Presidente da VITER.</p>	
7.3.1. 3	<p>Principais mudanças na equipe de risco nos últimos cinco anos.</p>
<p>Não houve mudanças na equipe de Riscos nos últimos cinco anos.</p>	
7.3.1. 4	<p>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).</p>
<p>As atividades desenvolvidas pela equipe de risco estão divididas em procedimentos operacionais, análises, monitoramento e proposição de critérios, metodologias e limites de exposição de risco de mercado, crédito e liquidez.</p> <p>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.</p>	
7.3.1. 5	<p>Quais são os relatórios de riscos, com que frequência são gerados, o que contêm e quem recebe e analisa estes relatórios?</p>
<p>Com o objetivo de garantir que os gestores e a alta administração possam responder e administrar tempestiva e apropriadamente, caso os níveis de exposição dos riscos extrapolem os limites estabelecidos, o monitoramento dos riscos é realizado diariamente e está estruturado com linhas de reporte efetivas, Alertas, que asseguram a avaliação e gerenciamento dos níveis de riscos assumidos pelos fundos conforme seu grau de comprometimento de limite.</p> <p>A definição dos Alertas estabelece as responsabilidades das unidades gestoras e das instâncias de governança envolvidas na avaliação e execução, bem como os procedimentos a serem seguidos em cada situação. Os Alertas são divididos em três faixas de acordo com o comprometimento do limite estabelecido sendo: Alerta Amarelo; Alerta Laranja e Alerta Vermelho.</p> <p>O Alerta Amarelo funciona como gatilho para atenção da gerência de risco que passa a monitorar a exposição mais detalhadamente. Variações abruptas dentro deste alerta geram reportes específicos aos gestores e aos membros do Comitê de Risco.</p> <p>O Alerta Laranja indica alta exposição aos limites estabelecidos o que enseja a convocação dos</p>	

membros do Comitê de Riscos para avaliação da exposição e dos riscos envolvidos e deliberação da estratégia de investimento e dos procedimentos adicionais de monitoramento a serem seguidos e implementados, conforme o caso. As deliberações são executadas pelos gestores e pela área de risco e acompanhadas pela área de compliance da VITER.

O Alerta Vermelho ocorre nos casos de extrapolação de limites que são informados pela GERAT aos gestores e à alta administração e submetidos para deliberação ao Comitê de Planejamento e Gestão com detalhamento dos motivos que levaram à extrapolação e com proposta para adequação da exposição aos níveis definidos, de aceitação da violação por um prazo definido ou por revisão do limite existente, sendo as decisões reportadas ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros.

A GERAT monitora, ainda, a evolução dos Alertas e comunica os gestores e a alta administração através de reportes periódicos acerca das reduções ou aumentos de exposição aos riscos identificados anteriormente.

As situações excepcionais ou não previstas na política e diretrizes de gestão de risco são analisadas e deliberadas no Comitê de Planejamento e Gestão sendo informada a decisão ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros. Tais situações são, ainda, analisadas pela área de risco que revisa os procedimentos e critérios estabelecidos de maneira a garantir que novas situações semelhantes ou decorrentes estejam previamente previstas na política.

7.3.2 - Risco de Crédito

7.3.2. 1	Descreva a metodologia de gestão do risco de crédito das carteiras.
-------------	---

O controle do risco de crédito é baseado em política de crédito e realizado por meio de processo de análise dos emissores dos ativos financeiros, atendendo à política de investimento de cada fundo.

A alocação em ativos privados considera a avaliação de risco de crédito realizada pela área de crédito da CAIXA, a remuneração do ativo, o enquadramento da operação nos limites estabelecidos e o atendimento da política de investimento do Fundo.

Os limites máximos de crédito são definidos considerando o tomador de forma individual, o grupo econômico/conglomerado, o valor de emissão, o objetivo da política de investimento do fundo, a exposição de cada produto e a exposição global considerando as notas de avaliação de risco de crédito e o prazo do ativo.

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 VITER 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 VITER 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.
<p>O processo de seleção, contratação e supervisão dos prestadores de serviços de gestão, distribuição, custódia e controladoria de fundos de investimento se baseiam em política, revisada periodicamente.</p> <p>Os fundos geridos pela VITER não têm como contraparte pessoas físicas nas operações de mercado. As operações realizadas pelos fundos e carteiras com a instituição administradora, gestora ou parte a elas relacionada são, a exemplo das demais operações, realizadas a preço de mercado.</p>	
7.3.3. 2	Como são selecionadas as contrapartes e aprovados seus limites?
<p>A seleção tem início com a solicitação de proposta comercial a, pelo menos, três prestadores. No processo, são observados os seguintes critérios: i) custo dos serviços; ii) histórico na prestação do serviço; iii) expertise relacionada à capacidade de atendimento da demanda (itens técnicos da proposta); e iv) rankings publicados pela ANBIMA.</p> <p>Adicionalmente, os processos de seleção dos prestadores de serviço são submetidos, por meio de voto, à deliberação em comitê, quando da constituição do fundo; caso a contratação do serviço seja posterior à deliberação da constituição do fundo, o comitê toma conhecimento do processo de seleção do prestador.</p> <p>Após aprovação, a contratação do prestador selecionado é precedida de processo de due diligence completo, se aplicável.</p> <p>A supervisão do prestador de serviços ocorre com base em procedimentos definidos em manuais operacionais de acordo com o tipo de serviço prestado e práticas de mercado.</p> <p>Os limites de exposição são aprovados pelo Comitê de Planejamento e Gestão da VITER e pelo Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros.</p> <p>O processo de seleção e contratação de corretoras é realizado com base em manual operacional específico, conforme exposto no item 7.2.4.</p>	
7.3.4 - Risco de Preço	
7.3.4.	Descreva a(s) metodologia(s) adotada(s) para a apuração do risco de preço (ex:

1	VaR, <i>Stress Test</i> , <i>Stop loss</i> , etc).
<p>O processo de gerenciamento de risco de mercado a que os fundos de investimento estão expostos divide-se em três etapas distintas: (1) determinação dos fatores de risco e quantificação de seus efeitos, (2) determinação dos níveis aceitáveis de exposições aos fatores de risco, (3) adequação das exposições de risco originais aos níveis definidos, objetivando desta forma o equilíbrio risco/retorno de cada fundo.</p> <p>O risco de mercado é mensurado, através da metodologia Value at Risk (VaR), sob condições normais de mercado, e também stress test.</p> <p>A aderência do modelo e dos parâmetros utilizados para cálculo do risco é verificada pelo processo de backtest.</p> <p>O limite de exposição ao risco de mercado é estabelecido considerando-se as características do fundo e seu perfil de risco. Na ocorrência de Desenquadramento de Limite de Risco o Comitê de Planejamento e Gestão é convocado, para avaliação e tomada de decisão. Para o gerenciamento do risco de mercado é utilizado sistema contratado junto ao mercado.</p>	
7.3.4. 2	Como são formalizados os controles de risco de preço?
<p>Os critérios de mensuração e os limites de exposição são propostos pela área de gerenciamento de riscos da VITER ao Comitê de Planejamento e Gestão da Vice-Presidência e ao Conselho de Gestão de Ativos de Terceiros para aprovação.</p>	
7.3.4. 3	Como é realizado o controle e o monitoramento de limites das estratégias (ex.: <i>books</i> tais como volatilidades, direcionais, arbitragens etc)? Com que frequência de atualização?
<p>O controle e monitoramento de limites das estratégias são realizados pela GERAT - Gerencia de Risco de Ativos de Terceiros.</p>	
7.3.4. 4	Nos casos de posições que ultrapassem seus limites, como é o processo de tomada de decisão para o reenquadramento?
<p>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.</p>	
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.
<p>O gerenciamento do risco de liquidez utiliza práticas de maneira a evitar escassez de caixa e</p>	

<p>dificuldades em honrar os resgates solicitados, utilizando modelo baseado em histórico de aplicações e resgate e em índice de negociabilidade dos ativos no mercado secundário. Além disso, é monitorada a concentração de volumes financeiros por prazo e por cotistas.</p> <p>A metodologia de mensuração do risco de liquidez contempla projeção de fluxo de caixa baseado em histórico de entradas e saídas, classificação de liquidez que utiliza o histórico de negociação dos ativos no mercado secundário, prazo de cotização e acompanhamento de concentração de volumes por vencimentos, por prazo e por cotistas.</p> <p>O limite de exposição ao risco de liquidez é definido considerando o perfil do passivo do fundo, o nível de exposição dos ativos alocados em carteira, os custos e despesas.</p>	
7.3.5. 2	<p>Como é realizado o controle e o monitoramento de limites das estratégias (ex.: <i>books</i> tais como volatilidades, direcionais, arbitragens etc)? Com que frequência de atualização?</p>
<p>Não há limites de liquidez por estratégia.</p>	
<p>7.3.6 - Risco Operacional</p>	
7.3.6. 1	<p>Descreva a metodologia de gestão do risco operacional.</p>
<p>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.</p> <p>Além disso, o corpo gerencial e equipe técnica responsáveis como 1ª Linha de Defesa, a GERAT e a Vice-Presidência de Riscos no âmbito da 2ª 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.</p>	
7.3.6. 2	<p>Descreva os procedimentos de confirmação de ordens executadas e de checagem das posições das carteiras e custódia.</p>
<p>A confirmação das ordens executadas é feita através da carteira e demonstrativo de caixa, fornecidos diariamente pelo custodiante (serviço prestado por terceiros).</p> <p>O controle das carteiras e da custódia do fundo é feita através de planilha de acompanhamento onde são feitos os batimentos das ordens executadas, da precificação dos ativos do fundo, da composição da carteira, dos limites de enquadramento e das provisões das taxas e despesas (CVM, SELIC, taxa de administração, etc.).</p> <p>Todo o acompanhamento feito em planilha baseia-se no Regulamento do Fundo e nas normas vigentes.</p>	
7.3.6. 3	<p>Descreva os principais pilares dos planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados pela sua empresa.</p>
<p>A CAIXA criou em 2004 o Programa de Continuidade dos Negócios – PCN CAIXA, para atuar frente</p>	

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.

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 implementar ações de respostas tempestivas às interrupções;
- d) Realizar testes e manutenção dos planos.

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.

A Política de Continuidade dos Negócios na CAIXA é aderente às melhores práticas de mercado, às normas BS 25999 e NBR 15999 e às regulamentações vigentes no Brasil. São adotados os modelos dos institutos internacionais DRII – Disaster Recovery Institute International e BCI – Business Continuity Institute.

Adicionalmente, a VITER possui um Plano de Resposta a Emergências, que tem por objetivo garantir a continuidade dos negócios em situações de contingência, tendo como principais pilares:

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

7.3.6. Descreva a política de segurança da informação.

4

OBJETIVO

Estabelecer princípios e diretrizes para proteção e disciplina do uso dos ativos de informação da CAIXA ou sob sua custódia, assegurando a confidencialidade, integridade, autenticidade e disponibilidade.

PRINCÍPIOS

DISPONIBILIDADE - Propriedade da informação de estar acessível e utilizável sob demanda por

uma entidade autorizada.

INTEGRIDADE - Propriedade de salvaguarda da exatidão e completeza da informação.

CONFIDENCIALIDADE - Propriedade de que a informação não esteja disponível ou revelada a indivíduos, entidades ou processos não autorizados.

AUTENTICIDADE - Propriedade de que a informação é verdadeira e fidedigna tanto na origem quanto no destino.

DIRETRIZES

As informações, ativos essenciais para a CAIXA, são protegidas contra alteração, destruição, divulgação, cópia e impressão não autorizadas, acidentais ou intencionais.

A recuperação da informação é assegurada como uma das formas de resguardar a continuidade dos negócios da CAIXA. As senhas, ou outros mecanismos utilizados no controle de acesso aos sistemas da CAIXA, são pessoais e intransferíveis e não são compartilhadas.

As informações são classificadas conforme seu 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 a 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 exigência legal.

A prática de “Mesa Limpa e Tela Limpa” é adotada por todos os usuários.

Os clientes e todos os usuários são sensibilizados quanto à importância da Segurança da Informação.

Os empregados conhecem as suas responsabilidades com referência à Segurança da Informação.

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.

A Política de Segurança da Informação é revisada, sempre que se fizer 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?
<p>Sim, há ramais onde são gravadas as ligações telefônicas. A escuta das gravações é realizada sempre que houver dúvida sobre o entendimento de conversas realizadas.</p> <p>O acesso às gravações é autorizado somente a gestores e à Área de Conformidade.</p>	
7.3.6. 6	Descreva os procedimentos de <i>back-up</i> e redundância de informações, <i>desktops</i> e servidores (para <i>back-up</i> , cite especificamente a periodicidade, local e prazo de armazenamento).
<p>Os procedimentos de realização do backup e da restauração de dados são periódicos e atendem as definições das áreas gestoras dos sistemas e das informações, e formalizados nos manuais operacionais pertinentes. No caso dos arquivos imprescindíveis à continuidade das atividades, são atualizados diariamente, no servidor em servidor específico.</p> <p>Além disso, a CAIXA conta com Datacenter localizado no Parque Tecnológico Capital Digital em Brasília e no Centro Tecnológico Caixa (CTC) com níveis elevados de segurança e disponibilidade.</p>	
7.3.6. 7	Descreva a política de controle de acesso ao <i>Data Center</i> (físico e lógico).
<p>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.</p>	
7.3.6. 8	Descreva o parque tecnológico atual da instituição. Citar <i>no-breaks</i> , capacidade dos servidores, <i>links</i> de internet e telefonia etc.
<p>A capacidade de processamento e armazenamento do Parque Tecnológico da CAIXA é de:</p> <ul style="list-style-type: none"> - 219.000 MIPS – milhões de instruções por Segundo; - 3.070 Terabytes de Armazenamento Centralizado; - 1.671 Terabytes de Armazenamento Descentralizado; - 12.890 Servidores de plataforma baixa; - 46 Servidores de plataforma intermediária; - 07 Silos Robóticos; - 07 Virtual Storage Manager (VSM); - 4.969 Roteadores; - 302 Switches (Centralizado) 	
7.3.6.9	A instituição possui filtro de e-mail, <i>firewall</i> e sistemas de antivírus?

Sim.	
7.3.6.1 0	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 <i>compliance</i> e auditoria interna e a quem se reportam?
Na CAIXA, o responsável pelas áreas de Compliance é o Vice-Presidente de Riscos – VICOR, que se reporta diretamente à Presidência da CAIXA. Considerando a segregação e especialização das atividades da Vice-presidência de Ativos de Terceiros - VITER, há uma equipe da Gerência Nacional de Risco de Ativos de Terceiros – GERAT, especialmente dedicada à conformidade dos serviços de administração fiduciária e gestão de recursos de terceiros, que se reporta diretamente à VITER e atua em conjunto com a VICOR. A auditoria interna é realizada por unidades específicas (auditorias regionais/nacionais) que se reportam à Auditoria Geral vinculada diretamente 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 (VITER), cada empregado ou dirigente é orientado a realizar a leitura do Código de Ética da CAIXA e o Código de Conduta da VITER. Em sequência o empregado assina declaração atestando o conhecimento e concordância ao Código de Conduta. Também assina a declaração de não participação societária. O Código de Conduta está publicado em manual normativo interno. Anualmente ocorre a renovação da assinatura de forma eletrônica.	
8.3	Descreva a política de investimentos pessoais e seu monitoramento.
Deverão sempre observar as orientações abaixo quanto aos seus investimentos pessoais:	

INVESTIMENTOS	CONDIÇÕES/VEDAÇÕES/OBSERVAÇÕES
Day-trade	Vedado para qualquer ativo ou mercado
Derivativos	Vedado para qualquer ativo ou mercado
Ações	Vedado para qualquer mercado
Tesouro direto	Não possuem restrições
Fundos de Investimento não administrados e/ou geridos pela VITER	Não possuem restrições
Fundos Mútuos de Privatização	Não possuem restrições
Fundos de Investimento (FI/FIC) – condomínio fechado – Regidos pela ICVM 555 – Administrados/Geridos pela CAIXA/VITER	Autorização previa pelo Comitê de Conduta da VITER à época do lançamento ou a qualquer outro tempo, evidenciando-se sempre na proposta a ausência/mitigação de riscos de utilização de informações privilegiadas e conflitos de interesses.
Fundos de Investimento (FI/FIC) – classe RF Simples – Regidos pela ICVM 555 – Administrados/Geridos pela CAIXA/VITER	Autorização previa pelo Comitê de Conduta da VITER à época do lançamento ou a qualquer outro tempo, evidenciando-se sempre na proposta a ausência/mitigação de riscos de utilização de informações privilegiadas e conflitos de interesses.
Títulos de Renda Fixa de Instituições Financeiras	Por meio dos canais de distribuição de varejo e em condições de mercado - Emissão CAIXA. Por meio dos canais de distribuição de varejo e em condições de mercado, mediante autorização previa pelo Comitê de Conduta da VITER, evidenciando-se sempre na proposta a ausência/mitigação de riscos de utilização de informações privilegiadas e conflitos de interesses – demais emissores.
Títulos de crédito de instituição não financeira	Aquisição somente via Oferta Pública ou com Esforços Restritos. Exclusivamente pela CAIXA nos casos em que a CAIXA atue como intermediária na Oferta. Assinatura do Termo de Compromisso para Aquisição de Títulos Privados em Oferta Pública – Empregados VITER (Anexo V), bem como mediante a entrega semestral, à GERAT Conformidade, de documento que comprove a manutenção da quantidade de títulos privados adquiridos.
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 definidos 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 <i>front running</i> , vazamento de informações confidenciais etc. (exemplos de meios de comunicação alternativos: telefone celular, sistemas de mensagens instantâneas e de <i>webmail</i> externo)
Os empregados devem somente operar pelos meios de comunicação de suas mesas de operações;	

e em caráter excepcional, utilizar outros meios de comunicação, desde que as operações sejam imediatamente repassadas para a mesa de operações, para que reflitam nos sistemas internos das Instituições Participantes, respeitando assim os limites e outras restrições estabelecidas. O registro e conferência/autorização de operações são realizadas por diferentes empregados, havendo a gravação de ordens emitidas. Ademais, na VITER o corpo gerencial e a equipe técnica atuam de modo a identificar, evitar e/ou minimizar as ocorrências de inconformidade por meio de processos de avaliação, recomendação, monitoramento e reporte do riscos.

8.7 Como são verificados os procedimentos que visem ao combate à lavagem de dinheiro feitos pelos seus distribuidores.

Na ocasião da contratação de distribuidores, via contrato de Distribuição, os mesmos se responsabilizam por todo e qualquer procedimento de prevenção à lavagem de dinheiro visando evitar a ocorrência desse tipo de crime, responsabilizando-se, ainda, por realizar o cadastro dos investidores e os procedimentos de "know your client", isentando o Administrador de tal responsabilidade e comprometendo-se a fornecer cópia da documentação relativa ao cadastro dos investidores e aos procedimentos de "know your client" sempre que solicitado

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.

A VITER é uma vice-presidência segregada das demais e não integra o Conselho Diretor, conforme art. 34 do estatuto da CAIXA, de forma a assegurar os interesses dos clientes desse segmento de negócio, atender a regulação vigente no que diz respeito ao princípio da segregação de atividades, evitar conflitos de interesses e para que não ocorra qualquer interferência das demais áreas da instituição nesse processo. Eventuais situações de conflito de interesse relacionadas às demais atividades desempenhadas pela instituição são também 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 Gestão de Ativos de Terceiros, órgão colegiado deliberativo, responsável pela gestão e representação da CAIXA quanto às atividades da VITER.

O processo sob responsabilidade da VITER é apoiado e monitorado pela Vice-Presidência de Riscos - VICOR que tem como objetivos gerir o sistema de controle interno, promover compliance, a gestão e execução do monitoramento de 2ª linha de defesa e relacionamento com órgãos reguladores.

A VITER é monitorada, ainda, quanto ao atendimento à regulamentação emanada pelos órgãos reguladores e fiscalizadores, bem como às orientações expedidas pela autorregulação.

Há também equipe de conformidade especialmente dedicada às atividades da VITER e lotada fisicamente nas dependências da vice-presidência e subordinada diretamente ao vice-presidente, que atua na identificação e monitoramento de possíveis riscos operacionais, manutenção da conformidade da VITER em relação às normas e regulamentos internos e externos, decisões em comitês, manuais de alçadas e operacionais.

As áreas de conformidade da CAIXA (VITER e VICOR) participam de treinamentos periódicos, e possuem acesso às informações internas, de modo a acompanhar as atividades e ocorrências relacionadas à cada área de especialização e estão em dinâmica e constante interação, possuindo níveis de reporte e comunicação.

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.
------	---

As atividades de registro e conferência/autorização de operações são obrigatoriamente realizadas por diferentes empregados. A conferência das operações realizadas é efetuada também diariamente pelo Comitê Interno responsável. Além disso, as ordens são transmitidas por telefone, fax, e-mail ou outro meio eletrônico passível de registros e auditoria.

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.
------	--

É realizado monitoramento, diário, das operações referentes aos fundos de investimento e carteiras administradas com custódia na CAIXA, cuja contraparte seja a CAIXA ou Corretoras, no

qual é verificado se as taxas e os preços praticados correspondem ao praticado no mercado, conforme divulgação 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. Os custodiantes externos verificam, conforme estabelecido em contrato, a adesão a limites de risco, limites legais e regulamentares das posições dos fundos sob gestão da Caixa.	
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.
<p>O Código de Ética da CAIXA, o Código de Conduta de Empregados e Dirigentes da CAIXA e o Código de Conduta dos Empregados da Vice-Presidência de Gestão de Ativos de Terceiros – VITER dispõem sobre situações de potenciais conflitos de interesse. As violações aos Códigos de Ética e de Conduta estão sujeitas à abertura de procedimento de apuração de responsabilidade disciplinar e civil, gerida e controlada pela Corregedoria, a quem compete a normatização e a gestão do sistema de controle. A instauração e o acompanhamento do Processo Disciplinar e Civil compete aos dirigentes da CAIXA, das respectivas unidades subordinadas, para investigação de fato irregular de qualquer natureza, origem ou valor, sendo delegada essa competência ao gestor chefe de unidade, à Corregedoria e à Auditoria Interna, conforme regras definidas em normativos internos.</p> <p>Quanto à participação do corpo funcional da CAIXA/VITER em outros negócios, os Códigos supracitados estabelecem que os empregados e dirigentes da VITER não podem prestar serviços profissionais a empresas concorrentes, remunerados ou não, independentemente da relação em que se baseiem, ou ainda ter participação societária em empresas que tenham como objetivo serviços ou produtos ligados ao mercado financeiro e de capitais ou prestar serviços de consultoria em atividades correlatas ao mercado financeiro, que gerem conflitos ou potenciais conflitos de interesses em relação às atividades exercidas na CAIXA/VITER. Também devem se abster de integrar conselhos e/ou órgãos de administração e/ou fiscalização cuja atividade e/ou objeto social da empresa nos quais a CAIXA detenha participação os coloque em conflito de interesses potencial ou efetivo, nos termos das normas que disciplinam a atividade de administração de carteira de valores mobiliários.</p>	
8.14	Descreva as regras para o tratamento de <i>soft dollar</i> 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. O Código de Conduta não permite aceitar brindes de qualquer valor comercial.	

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?
O processo de avaliação da conformidade é realizado por meio do acompanhamento, monitoramento e verificação de indicadores de efetividade da Política de Compliance na atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, dos indicadores chave de riscos operacionais, com limites de tolerância definidos e pela realização de testes periódicos de conferência e controle. Nos testes de conferência e controle, é verificada a realização de atividades previstas em normativos internos, conforme Políticas Internas, e aderência das rotinas e/ou documentos às normas internas e externas. A periodicidade da realização desses testes ocorre de acordo com o processo/atividade monitorado.	
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 (<i>Proxy Voting</i>)	SIM
10.7	Relatório de Rating	SIM
10.8	Manual de Liquidez	CONFIDENCIAL
10.9	Política de <i>Suitability</i>	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: 27/01/2017
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/C	
1.2	Entrada e saída dos principais sócios.
	<p>NOMEAÇÃO DO NOVO PRESIDENTE DA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL GILBERTO OCCHI EM 01/06/2016.</p> <p>EXONERAÇÃO DO VICE-PRESIDENTE MARCOS ROBERTO VASCONCELOS, RESPONSÁVEL PELA VITER – VICE PRESIDÊNCIA DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS, EM 26/07/2016.</p> <p>O DIRETOR EXECUTIVO DA VITER, FLAVIO ARAKAKI, ASSUMIU O CARGO INTERINAMENTE DESDE ENTÃO.</p>
1.3	ALTERAÇÃO NO QUADRO DE PROFISSIONAIS RESPONSÁVEIS PELAS ATIVIDADES DA EMPRESA GESTORA, INCLUINDO COMPLIANCE E RISCO.
N/C	
2 - Alterações desde a última atualização	
2.1	DATA DA ÚLTIMA ATUALIZAÇÃO.
	27/01/2017
2.2	QUAIS FORAM OS FATOS RELEVANTES DA EMPRESA GESTORA DESDE A ÚLTIMA ATUALIZAÇÃO?

EXONERAÇÃO DO VICE-PRESIDENTE MARCOS ROBERTO VASCONCELOS, RESPONSÁVEL PELA VITER – VICE PRESIDÊNCIA DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS, EM 26/07/2016.

O DIRETOR EXECUTIVO DA VITER, FLAVIO ARAKAKI, ASSUMIU O CARGO INTERINAMENTE DESDE ENTÃO.

2.3	Liste os itens alterados desde a última atualização do questionário.
-----	--

ITENS 3.3, 3.6, 3.7, 3.8, 4.2, 2.3, 2.4, 2.5, 2.11, 2.15, 3.1, 3.2, 6.3, 7.1.1, 7.1.2, 7.2.2, 7.3.1.1.
--

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO
(modelo mínimo conforme PORTARIA MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011)

Nos termos da Portaria MPS nº 519, de 2011, na redação dada pela Portaria nº MPS 440, de 2013, para receber as aplicações dos recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS), em caso de gestão própria, e assegurar as condições de segurança, rentabilidade, solvência e liquidez previstas nas Resoluções do Conselho Monetário Nacional – CMN nº 3.922, de 2010 e nº 4.604, de 2017, as instituições escolhidas para receber as aplicações dos RPPS devem ter sido objeto de prévio credenciamento. Em caso de fundos de investimento, o processo de credenciamento deve recair também sobre as instituições que atuam em sua administração ou gestão.

A referida Portaria estabelece em seu art. 3º, §§ 1º e 2º, os parâmetros mínimos para o processo de credenciamento e no art. 6º-E, 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”, cujos conteúdos mínimos constarão de formulário disponibilizado no endereço eletrônico do Ministério do Trabalho e Previdência Social (MTPS) na rede mundial de computadores – Internet.

Para tanto, está sendo publicado além do Termo de Análise de Credenciamento, que possui os **requisitos mínimos** para o credenciamento das instituições administradoras e gestoras de fundos de investimento, e que pode ser aplicado também aos intermediários, instituições integrantes do sistema de distribuição ou agentes autônomos de investimento, que recebam ou registrem ordens de compra ou venda dos RPPS ou que a estes ofereçam seus produtos, o modelo mínimo do Atestado de Credenciamento, no que couber. Não se aplica, porém, a prestadores de serviço eventualmente contratados pelo RPPS, aos quais por serem objeto de contratação com a administração pública devem observar a legislação aplicável.

As condições para credenciamento das entidades devem ser definidas pelo RPPS e avaliadas periodicamente de forma a garantir o equilíbrio de longo prazo da sua carteira de investimentos. Orientamos também que seja realizado Processo de Classificação, que consolida os critérios de análise das instituições e de seus respectivos fundos de investimento que irão impactar nas escolhas dos produtos aptos a receberem recursos dos RPPS e que os entes federativos estabeleçam em ato normativo critérios ou requisitos mínimos para credenciamento, de forma a não ser iniciado o processo para aquelas instituições que não os atendam.

O processo de credenciamento objetiva a escolha dos administradores e gestores de veículos financeiros que poderão ser posteriormente selecionados pelo RPPS para alocação, por meio de análise, não somente das características e riscos dos produtos de investimentos, mas também das instituições financeiras ou daquelas responsáveis pela sua administração e gestão.

A utilização do Termo de Análise de Credenciamento e do Atestado de Credenciamento não afasta a responsabilidade dos gestores do RPPS pela verificação do cumprimento dos requisitos mínimos para o credenciamento, da criteriosa análise do objetivo, política de investimentos e da carteira do fundo, devendo o RPPS estabelecer critérios adicionais de análise com o objetivo de garantir a melhor relação de risco e retorno aos ativos garantidores do plano de benefícios e a aderência a sua política de investimentos.

Deve ser preenchido um Termo de Análise de Credenciamento para cada Instituição administradora e gestora de fundo de investimento que a referida Instituição pretende se credenciar como administradora/gestora para futura decisão de investimento. Deve também ser efetuada uma análise individualizada de cada fundo de investimento, conforme modelo de Análise de(s) Fundo(s) de Investimento, a ser anexada ao presente termo. Ao final da análise deverá ser emitido o respectivo Atestado de Credenciamento.

Publicado no Orgão
Oficial do Município
Nº. 1082 Pg.
Data: de 22 a 31
Dez de 2017



ATESTADO DE CREDENCIAMENTO			
Ente Federativo	PREFEITURA MUNICIPAL DE FAZENDA RIO GRANDE	CNPJ	95.422.986/0001-02
Unidade Gestora do RPPS	INS. PREV. MUN. FAZENDA RIO GRANDE	CNPJ	05.145.721/0001-03
Instituição Administradora			
Razão Social	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CNPJ	00.360.305/0001-04
Número do Termo de Análise de Credenciamento		033/2017	
Data do Termo de Análise de Credenciamento		20/12/2017	
Instituição Gestora			
Razão Social	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CNPJ	00.360.305/0001-04
Número do Termo de Análise de Credenciamento		035/2017	
Data do Termo de Análise de Credenciamento		20/12/2017	
Outros			
Razão Social	-	CNPJ	-
Número do Termo de Análise de Credenciamento		-	
Data do Termo de Análise de Credenciamento		-	
Parecer final quanto ao credenciamento da(s) Instituições(s):	Após análise da documentação apresentada pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, o Comitê de Investimentos constatou que a mesma continua a atender os critérios exigidos pelo FAZPREV para recebimento de aplicações financeiras conforme dispõe e legislação vigente.		
Classe(s) de Fundo(s) de Investimento que as Instituições foram credenciadas para administração ou gestão de recursos alocados pelo RPPS (Resolução CMN nº 3.922/2010):	FI 100% títulos do TN		
	FI Renda Fixa/Referenciados		
	FI de Índices Referenciados em Renda Fixa		
	FI de Renda Fixa		
	FI em Direitos Creditórios		
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"		
	FI Ações referenciados		
	FI de Índices Referenciados em Ações		
	FI em Ações		
	FI Multimercado		
	FI em Participações		
	FI Imobiliário		
Fundo(s) de Investimento Analisado(s)	CNPJ	Data da Análise	
FI CAIXA BRASIL TP RENDA FIXA LP	05.164.356/0001-84	20/12/2017	
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	20/12/2017	
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	21.918.896/0001-62	20/12/2017	
FI CAIXA BRASIL IMAB 5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	20/12/2017	

FAZ PREV

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO
(modelo mínimo conforme PORTARIA MP5 nº 519, de 24 de agosto de 2011)

Nos termos da Portaria MP5 nº 519, de 2011, na reunião pública realizada em 09/12/2017, para avaliar os processos de licitação...

A comissão formada pelo(a) diretor(a) presidente e pelo(a) diretor(a) executivo...

As condições para o credenciamento são as seguintes: o candidato deve ser pessoa física...

O processo de credenciamento objetiva a seleção dos administradores e gerentes de valores financeiros...

A validade do Termo de Análise de Credenciamento é de 120 dias, contados a partir da data de assinatura...

Deixar preenchido o Termo de Análise de Credenciamento para cada instância administrativa e gerencial...

Table with columns: Nome, CPF, Data, Assinatura. Includes names like Anderson Gabriel Nobrega and Willian Gaspar.

Table with columns: Nome, CPF, Data, Assinatura. Includes names like Anderson Gabriel Nobrega and Willian Gaspar.

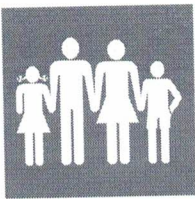
ATESTADO DE CREDENCIAMENTO
(modelo mínimo conforme PORTARIA MP5 nº 519, de 24 de agosto de 2011)
Nos termos da Portaria MP5 nº 519, de 2011, na reunião pública realizada em 09/12/2017...

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO
(modelo mínimo conforme PORTARIA MP5 nº 519, de 24 de agosto de 2011)
Nos termos da Portaria MP5 nº 519, de 2011, na reunião pública realizada em 09/12/2017...

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO form with fields for Ente Federativo, Unidade Gestora, Instituição Administradora, and various checkboxes for accreditation criteria.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO form with fields for Ente Federativo, Unidade Gestora, Instituição Administradora, and various checkboxes for accreditation criteria.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO form with fields for Ente Federativo, Unidade Gestora, Instituição Administradora, and various checkboxes for accreditation criteria.



FAZPREV

Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande

CNPJ 05.145.721/0001-03


ATO DE DECLARAÇÃO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº. 007/17 – PROCESSO Nº 452/2017

Declaro como inexigível a licitação, com fundamento no “caput” do art. 25, da Lei nº. 8.666/93, cujo objeto é o **CRENCIAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande – FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, para o credenciamento do **BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04**.

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente.

Face ao disposto no art. 26, da Lei nº 8.666/93, submeto o ato à autoridade superior para ratificação e devida publicidade.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.


FERNANDO DIOMAR DO AMARAL
PRESIDENTE DA COMISSÃO
PERMANENTE DE LICITAÇÃO
PORTARIA CONJUNTA 001/2017

Publicado no Órgão
Oficial do Município
Nº. 1082 Pg.
Data: de 22 a 31
Dez de 2017



FAZPREV

Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande

CNPJ 05.145.721/0001-03

RATIFICAÇÃO DO ATO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº 007/2017 - PROCESSO Nº 452/2017

Ratifico o ato do senhor Fernando Diomar do Amaral, Presidente da Comissão de Licitação, que declarou a licitação inexigível com fundamento no “Caput” do art. 25, I da Lei nº 8.666/93, cujo objeto é o **CRENCIAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande – FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, o **CRENCIAMENTO** do **BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04**.

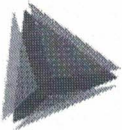
Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente, uma vez que o mesmo se encontra devidamente instruído.

Publique-se.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.

ANDERSON GABRIEL HOSHINO
DIRETOR PRESIDENTE
DECRETO 3616/2014

Publicado no Orgão
Oficial do Município
Nº 1082 Pg.
Data: de 22 a 31
Dez de 2017



Detalhes processo licitatório

Informações Gerais	
Entidade Executora	INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE FAZENDA RIO GRANDE
Ano*	2017
Nº licitação/dispensa/inexigibilidade*	7
Modalidade*	Processo Inexigibilidade
Número edital/processo*	452/2017
Recursos provenientes de organismos internacionais/multilaterais de crédito	
Instituição Financeira	
Contrato de Empréstimo	
Descrição Resumida do Objeto*	CRENCIAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES ADMINISTRADORAS E GESTORAS, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO -
Dotação Orçamentária*	1301092710011209233903999990
Preço máximo/Referência de preço - R\$*	0,00
Data Publicação Termo ratificação	31/12/2017
Data Cancelamento	

FAZPREV
Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande
CNPJ 00.360.305/0001-04

**ATO DE DECLARAÇÃO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº. 006/17 -
PROCESSO Nº 451/2017**

Declaramo como inexigível a licitação, com fundamento no "caput" do art. 25, da Lei nº. 8.666/93, cujo objeto é o **CREDECIONAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande - FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, para o credenciamento do **BANCO ITAÚ S/A, CNPJ 00.701.190/0001-04**.

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente.

Faço ao disposto no art. 26, da Lei nº 8.666/93, submeto o ato à autoridade superior para ratificação e devida publicidade.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.

FERNANDO DIOMAR DO AMARAL
PRESIDENTE DA COMISSÃO
PERMANENTE DE LICITAÇÃO
PORTARIA CONJUNTA 001/2017

Avenida Cadeo, 307 - Bairro Esquilipes - CEP 83.820-004 - Fazenda Rio Grande - PR.
Fone: 41-3628-9554 - fazprev@fazprev.com.br - www.fazprev.com.br

FAZPREV
Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande
CNPJ 00.360.305/0001-04

**ATO DE DECLARAÇÃO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº. 007/17 -
PROCESSO Nº 452/2017**

Declaramo como inexigível a licitação, com fundamento no "caput" do art. 25, da Lei nº. 8.666/93, cujo objeto é o **CREDECIONAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande - FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, para o credenciamento do **BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04**.

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente.

Faço ao disposto no art. 26, da Lei nº 8.666/93, submeto o ato à autoridade superior para ratificação e devida publicidade.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.

FERNANDO DIOMAR DO AMARAL
PRESIDENTE DA COMISSÃO
PERMANENTE DE LICITAÇÃO
PORTARIA CONJUNTA 001/2017

Avenida Cadeo, 307 - Bairro Esquilipes - CEP 83.820-004 - Fazenda Rio Grande - PR.
Fone: 41-3628-9554 - fazprev@fazprev.com.br - www.fazprev.com.br

FAZPREV
Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande
CNPJ 00.360.305/0001-04

**ATO DE DECLARAÇÃO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº. 008/17 -
PROCESSO Nº 453/2017**

Declaramo como inexigível a licitação, com fundamento no "caput" do art. 25, da Lei nº. 8.666/93, cujo objeto é o **CREDECIONAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande - FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, para o credenciamento do **BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04**.

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente.

Faço ao disposto no art. 26, da Lei nº 8.666/93, submeto o ato à autoridade superior para ratificação e devida publicidade.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.

FERNANDO DIOMAR DO AMARAL
PRESIDENTE DA COMISSÃO
PERMANENTE DE LICITAÇÃO
PORTARIA CONJUNTA 001/2017

Avenida Cadeo, 307 - Bairro Esquilipes - CEP 83.820-004 - Fazenda Rio Grande - PR.
Fone: 41-3628-9554 - fazprev@fazprev.com.br - www.fazprev.com.br

FAZPREV
Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande
CNPJ 00.360.305/0001-04

**RATIFICAÇÃO DO ATO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº 006/2017 -
PROCESSO Nº 451/2017**

Ratifico o ato do senhor Fernando Diomar do Amaral, Presidente da Comissão de Licitação, que declarou a licitação inexigível com fundamento no "Caput" do art. 25, I da Lei nº 8.666/93, cujo objeto é o **CREDECIONAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande - FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, o **CREDECIONAMENTO do BANCO ITAÚ S/A, CNPJ 00.701.190/0001-04**.

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente, uma vez que o mesmo se encontra devidamente instruído.

Publique-se.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.

ANDERSON GABRIEL HOSHINO
DIRETOR PRESIDENTE
DECRETO 0618/2014

Avenida Cadeo, 307 - Bairro Esquilipes - CEP 83.820-004 - Fazenda Rio Grande - PR.
Fone: 41-3628-9554 - fazprev@fazprev.com.br - www.fazprev.com.br

FAZPREV
Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande
CNPJ 00.360.305/0001-04

**RATIFICAÇÃO DO ATO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº 007/2017 -
PROCESSO Nº 452/2017**

Ratifico o ato do senhor Fernando Diomar do Amaral, Presidente da Comissão de Licitação, que declarou a licitação inexigível com fundamento no "Caput" do art. 25, I da Lei nº 8.666/93, cujo objeto é o **CREDECIONAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande - FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, o **CREDECIONAMENTO do BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04**.

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente, uma vez que o mesmo se encontra devidamente instruído.

Publique-se.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.

ANDERSON GABRIEL HOSHINO
DIRETOR PRESIDENTE
DECRETO 0618/2014

Avenida Cadeo, 307 - Bairro Esquilipes - CEP 83.820-004 - Fazenda Rio Grande - PR.
Fone: 41-3628-9554 - fazprev@fazprev.com.br - www.fazprev.com.br

FAZPREV
Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande
CNPJ 00.360.305/0001-04

**RATIFICAÇÃO DO ATO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº 008/2017 -
PROCESSO Nº 453/2017**

Ratifico o ato do senhor Fernando Diomar do Amaral, Presidente da Comissão de Licitação, que declarou a licitação inexigível com fundamento no "Caput" do art. 25, I da Lei nº 8.666/93, cujo objeto é o **CREDECIONAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande - FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, o **CREDECIONAMENTO do BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04**.

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente, uma vez que o mesmo se encontra devidamente instruído.

Publique-se.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.

ANDERSON GABRIEL HOSHINO
DIRETOR PRESIDENTE
DECRETO 0618/2014

Avenida Cadeo, 307 - Bairro Esquilipes - CEP 83.820-004 - Fazenda Rio Grande - PR.
Fone: 41-3628-9554 - fazprev@fazprev.com.br - www.fazprev.com.br



436

F A Z P R E V

CÓPIA

Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande

CNPJ 05.145.721/0001-03

Ofício nº. 329/2017

Fazenda Rio Grande, 28 de dezembro de 2017.

À Secretaria Municipal de Administração,

Visando dar publicidade às ações deste Instituto de Previdência, encaminho para Publicação no Diário Oficial do Município, para que o mesmo surta efeitos:

- **ATO DE DECLARAÇÃO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº 007/2017 - PROCESSO Nº 452/2017 - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL / ADMINISTRADORA.**

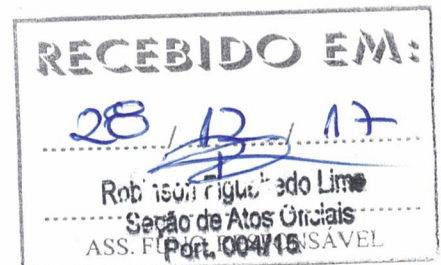
Solicitamos que após a devida publicação do comunicado, uma via retorne a este Instituto de Previdência com carimbo de publicado acompanhado como uma via do jornal impresso.

Sendo o que se apresenta, no aguardo de providências, agradecemos.

Atenciosamente,


WILLIAN GASPAR
DIRETOR EXECUTIVO- FAZPREV
DECRETO 3616/2014

Ilmo. Senhor
ROBINSON FIGUEIREDO LIMA
Atos Oficiais - Secretaria de Administração
Prefeitura Municipal
Fazenda Rio Grande - Paraná





FAZPREV

Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande

CNPJ 05.145.721/0001-03


ATO DE DECLARAÇÃO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº. 007/17 – PROCESSO Nº 452/2017

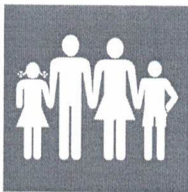
Declaro como inexigível a licitação, com fundamento no “caput” do art. 25, da Lei nº. 8.666/93, cujo objeto é o **CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande – FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, para o credenciamento do **BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04.**

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente.

Face ao disposto no art. 26, da Lei nº 8.666/93, submeto o ato à autoridade superior para ratificação e devida publicidade.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.


FERNANDO DIOMAR DO AMARAL
PRESIDENTE DA COMISSÃO
PERMANENTE DE LICITAÇÃO
PORTARIA CONJUNTA 001/2017



Ofício nº. 330/2017

Fazenda Rio Grande, 28 de dezembro de 2017.

À Secretaria Municipal de Administração,

Visando dar publicidade às ações deste Instituto de Previdência, encaminho para Publicação no Diário Oficial do Município, para que o mesmo surta efeitos:

- **RATIFICAÇÃO DO ATO DE DECLARAÇÃO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº 007/2017 - PROCESSO Nº 452/2017 - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL / ADMINISTRADORA.**

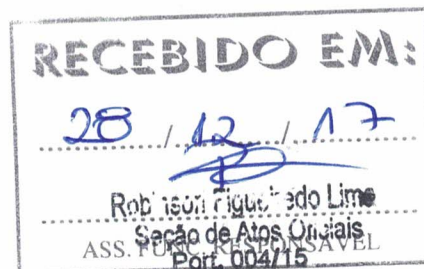
Solicitamos que após a devida publicação do comunicado, uma via retorne a este Instituto de Previdência com carimbo de publicado acompanhado como uma via do jornal impresso.

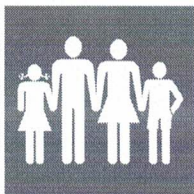
Sendo o que se apresenta, no aguardo de providências, agradecemos.

Atenciosamente,

WILLIAN GASPAR
DIRETOR EXECUTIVO- FAZPREV
DECRETO 3616/2014

Ilmo. Senhor
ROBINSON FIGUEIREDO LIMA
Atos Oficiais - Secretaria de Administração
Prefeitura Municipal
Fazenda Rio Grande - Paraná





FAZPREV

Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande

CNPJ 05.145.721/0001-03

**RATIFICAÇÃO DO ATO DE INEXIGIBILIDADE DE LICITAÇÃO Nº 007/2017 -
PROCESSO Nº 452/2017**

Ratifico o ato do senhor Fernando Diomar do Amaral, Presidente da Comissão de Licitação, que declarou a licitação inexigível com fundamento no “Caput” do art. 25, I da Lei nº 8.666/93, cujo objeto é o **CRENCIAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS E SIMILARES, SOCIEDADES CORRETORAS, DISTRIBUIDORAS DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS E PESSOAS JURÍDICAS QUE ATUEM COMO AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTO**, junto às quais o Instituto de Previdência Municipal de Fazenda Rio Grande – FAZPREV poderá vir a alocar seus recursos disponíveis, na forma do Edital 001/2017, o **CRENCIAMENTO do BANCO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, CNPJ 00.360.305/0001-04.**

Tudo de conformidade com os documentos que instruem o processo citado inicialmente, uma vez que o mesmo se encontra devidamente instruído.

Publique-se.

Fazenda Rio Grande, 20 de dezembro de 2017.


ANDERSON GABRIEL HOSHINO
DIRETOR PRESIDENTE
DECRETO 3616/2014

**NOVOS FUNDOS
CREDENCIADOS**

18/07/2018



▶ 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:

VITER - VICE PRESIDÊNCIA DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS

Data:

30/12/2016

(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	30388-7	
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).	PriceWaterhouseCoopers	
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	Fechamento	
1.18	Cotização: abertura ou fechamento?		
1.19	Regras para aplicação e resgate:		
	Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	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	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	%	
	Benchmark	Não Possui	
	Frequência	Não Possui	
	Linha-d'água	Não Possui	
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 os 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.		
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			

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.
<p>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.</p>	
2.1.5	Cite as premiações, ratings e rankings.
<p>Revista Exame 2004 - 2º lugar Categorias Fundos de Investimento e Fundos de Renda Fixa 2005 - Melhor Gestor de Varejo, Melhor Gestor de Atacado e Melhor Gestor de Renda Fixa 2006 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Varejo, Megafundos e Melhor Gestor de Atacador 2007 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Melhor Gestor de Varejo e Melhor Gestor de Megafundos 2008 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa 2009 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa Gestão Ativa 2010 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2011 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Varejo e 3º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2012 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Varejo 2013 - Melhores Fundos de Renda Fixa 2014 - Onde investir em 2014 – Os melhores Gestores 2015 - Onde investir em 2014 – Os melhores Gestores</p> <p>Revista Investidor Institucional 2013 - 1º Lugar Gestão de Fundos Multimercado 2014 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2015 - A CAIXA, também, foi eleita uma das maiores gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset – Agosto 2015, realizado pela revista Investidor Institucional. Conquistou a posição de maior gestora em três categorias: • Maior Gestor de Carteiras Administradas; • Maior Gestor de FIPs; • Maior Gestor de RPPS. 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais</p> <p>Rating Fitch Rating – “Mais alto Padrão” Perspectiva Estável</p> <p>Ranking ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2016)</p>	
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).
<p>SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS Sergio Henrique Oliveira Bini GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Camilo de Lellis Cavalcanti Junior GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Euclides José Garcia de Araújo</p>	
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
<p>Alteração do Superintendente Nacional – assume Sergio Henrique Oliveira Bini (Gerente Nacional da GEICO) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume Euclides José Garcia de Araújo (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume Carrilo de Lellis Cavalcanti Júnior (Gerente Executivo da GEFIX)</p>	
2.3 - Estratégias e Carteiras	
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
	Brasil (exclusivamente) <input checked="" type="checkbox"/> [X]
	Brasil (predominantemente) <input type="checkbox"/> especifique: N/A
	Global <input type="checkbox"/> 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?
	N/A
2.3.5 – Uso de Derivativos	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
2.3.5.1	
	Proteção de carteira ou de posição <input type="checkbox"/> SIM
	Mudança de remuneração/indexador <input type="checkbox"/> NÃO
	Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.) <input type="checkbox"/> NÃO
Alavancagem	
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
	Juros <input type="checkbox"/> SIM
	Câmbio <input type="checkbox"/> NÃO
	Ações <input type="checkbox"/> NÃO
	Commodities <input type="checkbox"/>
Em Bolsas:	
	Com garantia <input type="checkbox"/> SIM
	Sem garantia <input type="checkbox"/> NÃO
Em balcão:	
	Com garantia <input type="checkbox"/> SIM
	Sem garantia <input type="checkbox"/> 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
	398.216.901,24
3.2	PL médio em 12 meses
	263.748.040,48

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa	
	34.612.076.484,55	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?	
	N/A	
3.5	Número de cotistas	
	117	
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	
	40,59% e 59,45%	
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 VITER 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 resgates 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 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 apreamento é realizado considerando as informações 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 VITER - 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	2.113.829
	VaR 6 meses	1.609.338
	VaR 12 meses	1.377.046
	VaR 24 meses	1.348.401
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	-27.013.954
	Stress 6 meses	-22.745.326
	Stress 12 meses	-15.845.311
	Stress 24 meses	-13.756.045
4.16	Comente o último stop loss relevante do Fundo.	
	N/A	

5 - Comportamento do Fundo em Crises		Evento	Comportamento	Explicação	
Período					
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		Apação	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)				Contribuição (%)	
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?				
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 <i>conference calls</i> 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, <i>prime broker</i> , 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					
			Sim		Não
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				

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

**NOVOS FUNDOS
CREDENCIADOS**

01/08/2018



▶ 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:

29/12/2017

(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		
17.502.937/0001-68			
1.3	Data de início		
24/06/2013			
1.4	Classificação CVM		
Ações			
1.5	Classificação ANBIMA		
Ações Livre			
1.6	Código ANBIMA		
33907-5			
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 qualificados			
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).		
PriceWaterhouseCoopers			
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	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	D+4 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	%	
	Benchmark	Não Possui	
	Frequência	Não Possui	
	Linha-d'água	Não Possui	
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 recibos de ações de empresas estrangeiras negociadas no Brasil.			
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.
<p>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.</p>	
2.1.5	Cite as premiações, ratings e rankings.
<p>Revista Exame 2004 - 2º lugar Categorias Fundos de Investimento e Fundos de Renda Fixa 2005 - Melhor Gestor de Varejo, Melhor Gestor de Atacado e Melhor Gestor de Renda Fixa 2006 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Varejo, Megafundos e Melhor Gestor de Atacador 2007 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Melhor Gestor de Varejo e Melhor Gestor de Megafundos 2008 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa 2009 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa Gestão Ativa 2010 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2011 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Varejo e 3º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2012 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Varejo 2013 - Melhores Fundos de Renda Fixa 2014 - Onde investir em 2014 – Os melhores Gestores 2015 - Onde investir em 2015 – Os melhores Gestores</p> <p>Ranking Top Asset 2017 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração</p> <p>Revista Investidor Institucional 2013 - 1º Lugar Gestão de Fundos Multimercado 2014 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2015 - A CAIXA, também, foi eleita uma das maiores gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset – Agosto 2015, realizado pela revista Investidor Institucional. Conquistou a posição de maior gestora em três categorias: • Maior Gestor de Carteiras Administradas; • Maior Gestor de FIPs; • Maior Gestor de RPPS. 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais</p> <p>Rating Fitch Rating – “Forte”</p> <p>Ranking 2.2 - Equipe de Gestão do Fundo</p>	
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).
<p>SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS Sergio Henrique Oliveira Bini GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Camilo de Lellis Cavalcanti Junior GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Fabiano Penna Zimmermann</p>	
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
<p>Alteração do Superintendente Nacional – assume Sergio Henrique Oliveira Bini (Gerente Nacional da GEICO) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume Fabiano Penna Zimmermann (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume Camilo de Lellis Cavalcanti Júnior (Gerente Executivo da GEFIX)</p>	
2.3 - Estratégias e Carteiras	
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
Brasil (exclusivamente)	<input checked="" type="checkbox"/>
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?
N/A	
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
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	de fundos de terceiros? (S/N): -
2.3.6.1	de fundos do gestor? (S/N): S
2.3.6.2	
3 - Informações Adicionais	
3.1	PL atual
73.034.804,10	
3.2	PL médio em 12 meses
51.266.958,07	

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa	
	714.318.424,00	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?	
	N/A	
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	
	75,06% e 91,67%	
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 VITER 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 cotação 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 resgates 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 cotação. 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 informações 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, <i>Tracking Error</i> e <i>Expected Shortfall</i>)?	
	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 VITER – 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 <i>stress</i>)?	
	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	553.638
	VaR 6 meses	542.523
	VaR 12 meses	602.458
	VaR 24 meses	804.612
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 <i>stress</i> ?	
	N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?	
	N/A	
4.15	Qual o <i>stress</i> médio do Fundo nos últimos	
	Stress 3 meses	-12.863.719
	Stress 6 meses	-13.025.716
	Stress 12 meses	-11.843.291
	Stress 24 meses	-13.715.834
4.16	Comente o último <i>stop loss</i> relevante do Fundo.	
	N/A	

5 - Comportamento do Fundo em Crises		Evento	Comportamento	Explicação	
Período					
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)				Contribuição (%)	
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?				
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 <i>conference calls</i> 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, <i>prime broker</i> , 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



Análise de Fundo de Investimentos de Multimercado

DATA: 16/08/2018

Formulário de análise de fundos de investimentos regulamentados pela Instrução Normativa CVM nº 555. Contempla instituições; enquadramentos legais perante a resolução CMN nº 3922, alterada pela Instrução CMN nº 4604; análise de riscos e vedações da resolução supracitada.

COTISTA: FAZPREV
CNPJ: 05.145.721/0001-03

FUNDO
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO FIC

CNPJ
29.388.994/0001-47

INSTITUIÇÕES

GESTOR
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

CNPJ
00.360.305/0001-04

ADMINISTRADOR
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

CNPJ
00.360.305/0001-04

CUSTODIANTE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

CNPJ
00.360.305/0001-04

ENQUADRAMENTO

TIPO ATIVO
Artigo 8º - Inciso III

ENQUADRAMENTO PL DO GESTOR (PL R\$ 298.562.280.000,27)
R\$ 14.928.110.000,00 (Ranking Anbima mai/18)

ENQUADRAMENTO ATIVO
Até 10% do PL - Até R\$ 16.753.337,57

ENQUADRAMENTO PASSIVO 15% do PL
* RISCO: Ver análise abaixo 5% do PL

- VEDAÇÕES RES. CMN 3.922/4.604
- FUNDO não alavancado (Art. 23, I)
 - FUNDO não aplica em FIDC-NP (Art. 23, III)
 - FUNDO está previsto na resolução (Art. 23, V)
 - FUNDO não possui títulos ou afins emitidos no fundo (Art. 23, II)
 - FUNDO, se fundo de índice, negociado no mercado organizado (Art. 23, VI)
 - FUNDO enquadrado para investidores qualificados e/ou profissionais, se o RPPS atender a esses critérios (Art. 23, VII)

ANÁLISE DE RISCOS

CRÉDITO PRIVADO Sim, com limite máximo de aplicação do fundo em 5%. Não.

LIQUIDEZ CARÊNCIA Sim. Prazo: 01/10/2020
 Não.

COTIZAÇÃO DE RESGATE D+0
LIQUIDAÇÃO DE RESGATE D+2

MERCADO VOLATILIDADE inferior a 75% à do indexador.
 entre 75% e 125%.
 acima de 125%

INDEXADOR: Ibovespa
RISCO INDEXADOR - +19,12%

CARACTERÍSTICA (RES CMN 3.922)

Artigo 8º, III, Parágrafo 3º

- Instituição financeira autorizada pelo BACEN (I)
- Emitido por companhia aberta (exceto securitizadoras) (III)
- Cota de classe sênior quando FIDC (III)
- Cotas de FI dentro das condições anteriores (IV)

TAXAS

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 1,60%
TAXA DE INGRESSO: 0,00%

TAXA DE GESTÃO: 0,00%
TAXA DE PERFORMANCE: 0,00%

PARECER TÉCNICO

O FUNDO está enquadrado na Res. CMN no Art. 8º, III. Tratando-se de um fundo novo é importante o RPPS levar em consideração que não podemos calcular o critério mais restritivo para aporte, já que não temos a informação do PL do próprio fundo. O regulamento do fundo descreve as vedações impostas pela Res. Como é um FUNDO novo, não temos informações sobre sua rentabilidade, mas a rentabilidade do índice posto como referência - IBOVESPA - apresenta valorização de +17,33% nos últimos 12 meses. Não podemos calcular o risco de mercado do fundo, mas seu indexador - IBOVESPA - apresenta +19,12% de volatilidade. O FUNDO possui carência durante o período da estratégica, até 01/10/2020. Como possui carência, há risco de desenquadramento passivo caso o fundo não capte valores mínimos. Ademais, apresenta regras de resgate compatíveis com a sua classe, havendo a liquidação de resgate em até 2 dias úteis após a solicitação de resgate. O FUNDO está apto para o recebimento de recursos e fecha para captação em 24/08/2018, ou até captar R\$300 MM.

DISPOSIÇÕES FINAIS

A AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA, denominada CONSULTORIA, é autorizada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM), com especialidade no segmento previdenciário e institucional. Através do Ato Declaratório nº 14.576, de 20 de outubro de 2015, o Superintendente de Relações com Investidores Institucionais da Comissão de Valores Mobiliários, no uso da competência que lhe foi delegada pela Deliberação CVM nº 158, de 21/07/93, autoriza a AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA, C.N.P.J. nº 22.863.573/0001-81, a prestar os serviços de Consultor de Valores Mobiliários, previstos no artigo 27 da Lei nº 6.385/76, de 07 de dezembro de 1976. Assim como, os serviços prestados e informações passadas referente à consultoria de valores mobiliários, não garante resultados futuros ou a isenção de risco para com o investidor.

As informações divulgadas aqui têm caráter meramente informativo, não se constituindo em oferta de venda de fundos de investimentos. A CONSULTORIA não comercializa nem distribui quotas de fundos de investimentos ou qualquer outro ativo financeiro. As informações aqui contidas foram produzidas pela CONSULTORIA dentro das condições atuais de mercado e conjuntura, sendo que todas as recomendações e estimativas aqui apresentadas derivam de nosso julgamento e podem ser alteradas a qualquer momento sem aviso prévio. Ressaltamos que rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura e a rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. As informações deste site são exclusivamente informativas. Recomendamos ao investidor a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento dos fundos de investimento ao aplicar seus recursos. Ressaltamos que os fundos de investimentos não contam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. A CONSULTORIA não se responsabiliza por decisões de investimento tomadas com base nos dados aqui divulgados.



Fale Conosco
Rua Nereu Ramos, 942, Sala 301
Jardim Blumenau - Blumenau - SC
CEP: 89010-401
Fone: (48) 3232-2290
contato@amxcapital.com.br

R\$ 2.000.000,00

[Handwritten signatures and initials]

FIC Capital Protegido Bolsa de Valores Multimercado

CAIXA

Razão Social

Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Caixa Capital Protegido Bolsa de Valores Multimercado

CNPJ

29.388.994/0001-47

Público

Pessoas físicas, jurídicas (pública e privada) e RPPS

Classificação ANBIMA

Multimercado Capital Protegido

Movimentações

Aplicação Inicial: R\$ 5.000,00

Aplicação Adicional: R\$ 500,00

Saldo Mínimo: R\$ 4.000,00

Aplicações: D+0 / D+0

Resgates: D+0 / D+2

Carência: Até 01/10/2020

Cota: Fechamento

Horário de Movimentações: Até as 14h00 (Horário de Brasília).

Taxa de Administração

1,60% a.a

Tributação

Busca o Longo Prazo

Perfil de Risco

Arrojado

Início do Fundo

13/08/2018

Administrador e Distribuidor

Caixa Econômica Federal

Gestor

Caixa Econômica Federal

Custodiante

Caixa Econômica Federal

Auditor Independente

KPMG

Atendimento ao Cotista:

I - Pela "internet" nos endereços eletrônicos

a) www.caixa.gov.br

b) www.cvm.gov.br

II - SAC: 0800 726 0101

III - Ouvidoria Caixa: 0800 725 7474

IV - Atendimento a pessoas com deficiência auditiva: 0800 726 2492

O CAIXA **FIC Capital Protegido Multimercado** proporciona aos investidores a oportunidade de buscar ganhos compatíveis com o desempenho do IBOVESPA - Índice Bovespa, com a vantagem de proteção do capital investido.

Para atingir seu objetivo, o Fundo adota Estratégia vinculada ao IBOVESPA e IPCA Projetado. A Estratégia se encerra em **01 OUT 20**, buscando proporcionar um dos resultados abaixo:

Cenários	Varição acumulada do IBOVESPA ao término do Prazo da Estratégia	Resultados esperados
1	Positiva acima de 8,70% (inclusive) , sem atingir a barreira de alta	Capital Investido + O que for maior: IPCA Projetado ¹ (8,70% a.p.) ou Varição acumulada do IBOVESPA ²
2	Negativa ou Positiva abaixo de 8,70% , sem atingir a barreira de alta	Capital Investido + IPCA Projetado ¹ (8,70% a.p.)
3	Atingimento da Barreira de Alta (40%)	Capital Investido + IPCA Projetado ¹ (8,70% a.p.) + Taxa Prefixada de Alta (12,65% a.p.)

Barreira de Alta: 40% Taxa Prefixada de Alta: **12,65% a.p.** IPCA Projetado¹: **8,70% a.p.**

¹ IPCA Projetado para o período da operação estruturada do Sistema de Expectativas de Mercado do BACEN (Base 03/08/2018).
² Resultado acumulado do Ibovespa desde a data do início da Operação até o seu prazo de encerramento.
O retorno não é líquido dos custos do Fundo e impostos.

POR QUE INVESTIR EM FUNDO DE CAPITAL PROTEGIDO?

- Proteção do capital investido corrigido, no mínimo, pelo IPCA Projetado para o período ao final da Estratégia;
- Oportunidade de diversificação, diante de um cenário de incertezas e volatilidade;
- Acesso à estratégia sofisticada de produto.

O QUE MAIS PRECISO SABER?

- Para verificação da barreira de alta, utiliza-se como referência a pontuação do fechamento do IBOVESPA do dia 27 AGO 18;
- A barreira poderá ser atingida a qualquer momento durante a Estratégia, considerando inclusive a cotação *intra-day* do IBOVESPA;
- Fundo estará aberto para investimentos no Internet Banking CAIXA ou em sua agência de relacionamento, apenas até **24 AGO 18**;
- Ao final da Estratégia, o investidor obterá o valor investido, corrigido conforme os cenários indicados;
- Os resultados não são deduzidos de taxas e despesas inerentes ao funcionamento do Fundo, bem como encargos tributários, descritos no Regulamento.

LEIA O REGULAMENTO, O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES E LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS ANTES DE INVESTIR.

*O retorno não é líquido dos custos do Fundo e impostos.

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO. ESTE DOCUMENTO ESTÁ SUJEITO A MODIFICAÇÕES E TEM CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO, NÃO SE CONSTITUINDO EM ACONSELHAMENTO PARA AQUISIÇÃO DE COTAS DESTE FUNDO. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM A GARANTIA DO ADMINISTRADOR DO FUNDO, DO GESTOR DA CARTEIRA, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA DISPONÍVEL NO FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES.



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.



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

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA ECONOMICA FEDERAL

Questionário preenchido por:

VIART – VICE PRESIDÊNCIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIRO

Data:

09/08/2018

(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

Three handwritten signatures in blue ink are located at the bottom right of the page, overlapping a grey decorative bar.

Sumário

Apresentação.....	3
1) Informações sobre o Fundo de Investimento.....	4
1 - Alterações desde a última atualização	4
2 - Informações Qualitativas	6
2.1 – Perfil.....	6
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo.....	8
2.3 - Estratégias e Carteiras	9
3 - Informações Adicionais.....	10
4 - Gestão de Risco	11
5 – Comportamento do Fundo em Crises	13
6 - Três períodos de maior perda do Fundo (<i>peak to valley</i>)	13
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)	13
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores.....	13
9 – Atendimento aos Cotistas	14
10 - Investimento no Exterior	14
11 – Anexos	14
2) Declaração.....	16
3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento	17
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 Investimento.



3

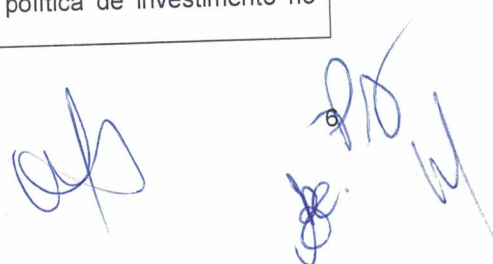
1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização	
1.1	Nome FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO
1.2	CNPJ 29.388.994/0001-47
1.3	Data de início 28/08/2018
1.4	Classificação CVM Multimercado
1.5	Classificação ANBIMA Multimercado Capital Protegido
1.6	Código ANBIMA N/A
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo? N/A
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações) Busca Longo Prazo
1.9	Público-alvo Pessoas físicas, jurídicas (pública e privada) e RPPS
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) N/A
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 AUDITORES INDEPENDENTES
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

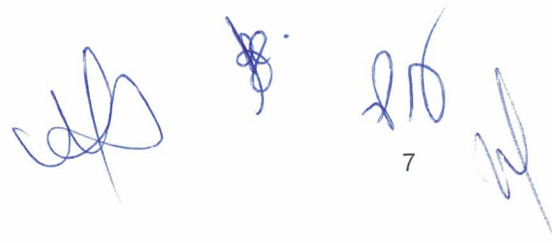
1.18	Cotização: abertura ou fechamento? Fechamento
------	---

[Handwritten signatures and initials]

1.19	Regras para aplicação e resgate:	
	Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	D+0 / D+0
	Carência/Tempo mínimo para permanência (<i>lock-up period</i>) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	De 28/08/18 a 01/10/2020 (inclusive)
	Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	D+0 / D+2
	Aplicação inicial mínima	R\$ 5.000,00
	Aplicação máxima por cotista	5% do PL do Fundo em caso de cotista RPPS
	Aplicação adicional mínima	R\$500,00
	Resgate Mínimo	R\$500,00
1.20	Taxa de Entrada (<i>upfront fee</i>)	
	N/A	
1.21	Taxa de Saída (<i>redemption fee</i>)	
	N/A	
1.22	Taxa de Administração	
	1,60% a.a.	
1.23	Taxa de Administração máxima	
	1,60% a.a.	
1.24	Taxa de Performance	
	• %	N/A
	• <i>Benchmark</i>	N/A
	• Frequência	N/A
	• Linha-d'água	N/A
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?	
	0,05% a.a.	
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.	
	O objetivo do FUNDO é buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas de fundos de investimento que acompanhem a variação do Índice Bovespa (“IBOVESPA”) com a proteção do capital investido, durante a vigência da “Estratégia”, e, findo os prazos, buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas de Fundos de Investimento que apliquem 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 processo de seleção de ativos financeiros baseia-se na análise de cenários econômico financeiros nacionais e internacionais. As decisões de alocação são tomadas em comitês, que se reúnem para avaliar as tendências do mercado e as condições macroeconômicas e microeconômicas, levando em consideração os níveis e limites de Risco definidos em Regulamento.
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 2004 - 2º lugar Categorias Fundos de Investimento e Fundos de Renda Fixa 2005 - Melhor Gestor de Varejo, Melhor Gestor de Atacado e Melhor Gestor de Renda Fixa 2006 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Varejo, Megafundos e Melhor Gestor de Atacador 2007 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Melhor Gestor de Varejo e Melhor e Melhor Gestor de Megafundos 2008 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa 2009 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa Gestão Ativa 2010 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2011 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Vaerejo e 3º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2012 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Varejo 2013 - Melhores Fundos de Renda Fixa 2014 - Onde investir em 2014 – Os melhores Gestores 2015 - Onde investir em 2014 – Os melhores Gestores Revista Investidor Institucional 2013 - 1º Lugar Gestão de Fundos Multimercado 2014 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2015 - A CAIXA, também, foi eleita uma das maiores gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset – Agosto 2015, realizado pela revista Investidor Institucional. Conquistou a posição de maior gestora em três categorias: <ul style="list-style-type: none">• Maior Gestor de Carteiras Administradas;• Maior Gestor de FIPs;• Maior Gestor de RPPS. 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais Rating Fitch Rating – “Mais alto Padrão” Perspectiva Estável Ranking ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (06/2018)	
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 Sergio Henrique Oliveira Bini GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Camilo de Lellis Cavalcanti Junior GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Fabiano Penna Zimmermann	
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.
Alteração do Superintendente Nacional – assume Sergio Henrique Oliveira Bini (Gerente Nacional da GEICO) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume Camilo de Lellis Cavalcanti Júnior	



8

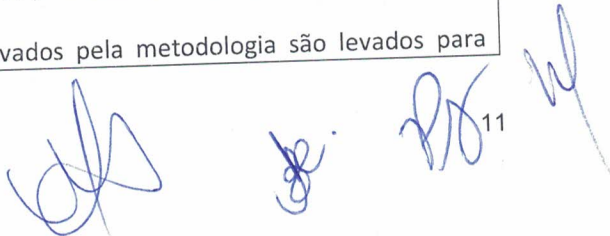
(Gerente Executivo da GEFIX)	
Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume Fabiano Pena Zimmermann (Gerente Executivo da GEFIX)	
2.3 - Estratégias e Carteiras	
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:
▪ Brasil (exclusivamente)	X
▪ Brasil (predominantemente)	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.).
Resumidamente, a carteira é composta de duas partes, com funções distintas:	
1. Para proporcionar um retorno nominal mínimo antes de custos – LTN de maturidade idêntica a da operação (efetiva: 02/01/2020); swap ativo em taxa pré-fixada e passivo em taxa pós-fixada, com garantia, negociado no mercado de balcão da B3, conjugado a posições em Letras Financeiras do Tesouro (LFT) e operações compromissadas com liquidez diária.	
2. Para indexação ao Ibovespa dentro de determinados cenários – opções de compra sobre o Ibovespa com knock-out simples e rebate, com garantia, negociadas no mercado de balcão da B3.	
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?
Permitido operações de day trade	
2.3.5 – Uso de Derivativos	
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:
• Proteção de carteira ou de posição	Sim X Não <input type="checkbox"/>
• Mudança de remuneração/indexador	Sim X Não <input type="checkbox"/>
• Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)	Sim X Não <input type="checkbox"/>
• Alavancagem	Sim <input type="checkbox"/> Não X
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:
Juros	Sim X Não <input type="checkbox"/>
Câmbio	Sim <input type="checkbox"/> Não X
Ações	Sim <input type="checkbox"/> Não X
Commodities	Sim <input type="checkbox"/> Não X
Em Bolsas:	
• Com garantia	Sim X Não <input type="checkbox"/>
• Sem garantia	Sim <input type="checkbox"/> Não X
Em balcão:	
• Com garantia	Sim X Não <input type="checkbox"/>
• Sem garantia	Sim <input type="checkbox"/> Não X
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento	
2.3.6.1	de fundos de terceiros?
	Sim <input type="checkbox"/> Não X
2.3.6.2	de fundos do gestor?
	Sim X Não <input type="checkbox"/>

[Handwritten signatures and initials]

3 - Informações Adicionais	
3.1	PL atual
N/A	
3.2	PL médio em 12 meses
N/A	
3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
R\$ 8.335.170.817,67	
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
N/A	
3.5	Número de cotistas
N/A	
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
N/A	
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?
N/A	
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 VITER 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 resgates 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 informações 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

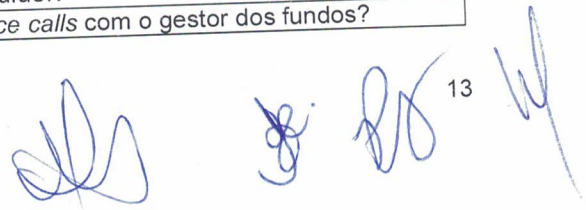


11

decisão no Comitê de Marcação a Mercado.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, <i>Tracking Error</i> e <i>Expected Shortfall</i>)?
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 VITER – 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 <i>stress</i>)?
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.
N/A	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
3 meses?	N/A
6 meses?	N/A
12 meses?	N/A
24 meses?	N/A
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocial máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
N/A	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de <i>stress</i> ?
N/A	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o <i>stress</i> médio do Fundo nos últimos
3 meses?	N/A
6 meses?	N/A
12 meses?	N/A
24 meses?	N/A
4.16	Comente o último <i>stop loss</i> relevante do Fundo.
N/A	

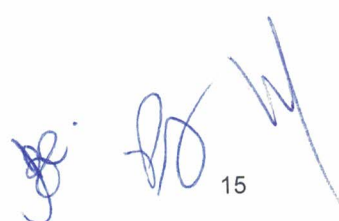


5 – Comportamento do Fundo em Crises					
	Período	Evento	Comportamento	Explicação	
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A	N/A	
	Ago/98	Crise da Rússia	N/A	N/A	
	Out/98	Quebra do LTCM	N/A	N/A	
	Jan/99	Desvalorização do Real	N/A	N/A	
	Mar/00	Crise do Nasdaq	N/A	N/A	
	Abr/01	Apagão	N/A	N/A	
	Set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A	N/A	
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A	N/A	
	Jun/02	Marcação a mercado	N/A	N/A	
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A	N/A	
	Mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A	N/A	
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A	N/A	
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A	N/A	
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A	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.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
3.	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)					
7.1	Atribuição		Contribuição (%)		
	N/A		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 <i>conference calls</i> 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, <i>prime broker</i> , 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 <input checked="" type="checkbox"/> Não <input type="checkbox"/>
11.2	Prospecto	Sim <input type="checkbox"/> Não <input checked="" type="checkbox"/>
11.3	Última lâmina	Sim <input type="checkbox"/> Não <input checked="" type="checkbox"/>
11.4	Último Informe de Perfil Mensal (Arquivo XML - Padrão CVM) da carteira	Sim <input type="checkbox"/> Não <input checked="" type="checkbox"/>
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo (Arquivo XML - Padrão CVM)	Sim <input type="checkbox"/> Não <input checked="" type="checkbox"/>

11.6	Relatórios de Gestão	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input checked="" type="checkbox"/>
------	----------------------	------------------------------	---



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.

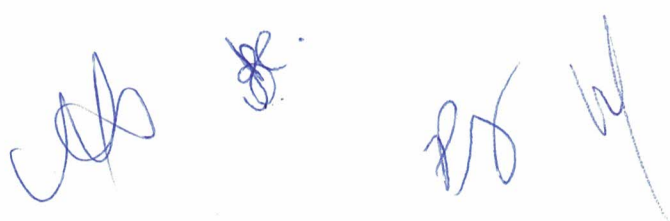
Local:	Data:
Nome:	
Cargo:	

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



Material de Divulgação

23.215.097/0001-55

Informações referentes a jul/18

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Público Alvo:

O FUNDO destina-se a acolher investimentos dos Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS, instituídos pelos Estados, Municípios e Distrito Federal do Brasil, entes públicos nas esferas municipal, estadual e federal, Autarquias, Entidades Públicas e Entidades Fechadas De Previdência Complementar, previamente cadastrados perante a ADMINISTRADORA.

Objetivo e Política de Investimento:

Investir no mínimo 95% do patrimônio líquido do FUNDO em cotas de fundos de investimento da classe renda fixa, cuja carteira seja composta exclusivamente por títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas. O FUNDO deverá manter, direta ou indiretamente, 100% de seu patrimônio líquido aplicado em ativos financeiros de baixo risco de crédito, estando exposto ao risco das variações das taxas de juros prefixadas, pós fixadas e/ou índices de preços. Tendo como objetivo superar a rentabilidade do Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo - IPCA.

Demais Observações:

Para fins de atendimento das normas destinadas aos RPPS, será procedido ao envio das informações da carteira do FUNDO ao Ministério da Previdência Social na forma e periodicidade por ele estabelecido.

RENTABILIDADE

Ano	Fundo	IPCA	% Bench
2013			
2014			
2015			
2016	1,691%	0,453%	373,29%
2017	11,217%	2,947%	380,62%

Mês	Fundo	IPCA	% Bench
ago/17	1,081%	0,190%	568,94%
set/17	0,809%	0,160%	505,39%
out/17	0,413%	0,420%	98,43%
nov/17	0,273%	0,280%	97,60%
dez/17	0,795%	0,440%	180,76%
jan/18	1,006%	0,290%	346,97%
fev/18	0,645%	0,320%	201,56%
mar/18	1,177%	0,090%	1307,65%
abr/18	0,330%	0,220%	149,97%
mai/18	-1,169%	0,400%	-
jun/18	0,450%	1,260%	35,70%
jul/18	0,948%	0,331%	286,56%
Ano	3,417%	2,943%	116,11%
12 Meses	6,949%	4,486%	154,91%

Para o cálculo da rentabilidade é utilizada a cota do último dia útil do mês.
*A utilização do IPCA para comparativo de rentabilidade é mero referência econômica e não parâmetro de objetivo do fundo.

PARÂMETROS DO FUNDO

Taxa de Administração	De 0,20% a 0,40% a.a **	Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Livre Soberano ****
Aplicação Inicial	1.000,00	Data Início	04/11/16
Aplicações Adicionais	-	Aplicação (deb./conv.)	D0 / D0
Resgate Mínimo	-	Resgate (conv./créd.)	D0 / D0
Saldo Mínimo	-	Cota Utilizada	Fechamento
Liquidez	Diária	Classificação de Risco	Moderado
Horário Permitido	16h00 *	Enquadramento	CMN 3.922/10 Art. 7º, Inciso IV "a"

* Horário de Brasília

*** Descrição do tipo Anbima disponível no Formulário de Informações Complementares

INFORMAÇÕES DE RISCO

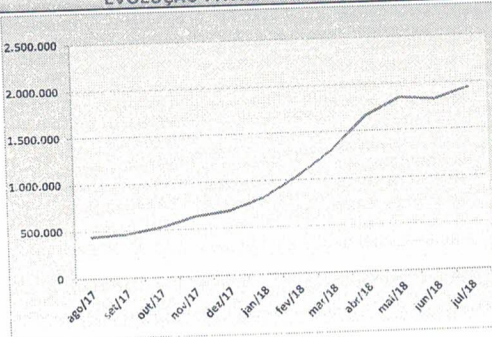
Volatilidade no ano ⁽¹⁾	1,8922%	Volatilidade nos últimos 12 m ⁽¹⁾	1,6039%
Tracking error no ano ⁽²⁾	1,9247	Tracking error nos 12 m ⁽²⁾	1,6320
% retornos positivos no ano	68,49%	% retornos positivos últimos 12 m	69,60%
Índice de Sharpe no ano ⁽³⁾	0,3291	Índice de Sharpe nos 12 m ⁽³⁾	1,5419

Obs: Fundo não possui histórico de cota no período.

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Operações Compromissadas	49,08%
LFT	32,54%
LTN	16,83%
NTNF	1,47%
Derivativos	0,09%

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL (R\$ mil)



PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO - 12 MESES

1.098.474.532,26

Fundo Investido

FI CAIXA BRASIL RFP-M TI PUB RF LP

Regulamentação:

Instrução CVM 555/14 e alterações posteriores
Regulamento, Formulário de Inf. Complementares e Lâmina de Informações Essenciais disponíveis no site da CAIXA: www.caixa.gov.br
Portal de educação financeira da ANBIMA - Como Investir: www.comoinvestir.com.br

Administrador

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestor

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Distribuidor

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Custodiante

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Auditor

PROINTERHOUSE/Coopers Auditores Independentes

Atendimento ao Cotista:

As informações sobre o Fundo poderão ser consultadas:

- I - Diretamente nas Agências e/ou PABs
- II - Pela "internet" nos endereços eletrônicos:
 - a) www.caixa.gov.br
 - III - SAC: 0800 726 0101
 - IV - Ouvidoria Caixa: 0800 725 7474
 - V - Atendimento a pessoas com deficiência auditiva: 0500 832 2492

Supervisão e Fiscalização

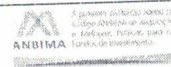
Comissão de Valores Mobiliários - CVM
Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.

IOF: 1% ao dia, limitado ao rendimento do Fundo, de acordo com tabela decrescente em função do prazo de aplicação.

Aos cotistas isentos, imunes ou dispensados de retenção na fonte e do pagamento em separado do Imposto de Renda sobre os rendimentos e ganhos auferidos no Fundo não incidirá Tributação.

ESTE DOCUMENTO ESTÁ SUJEITO A MODIFICAÇÕES E TEM CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO. NÃO SE CONSTITUIRÁ EM CONSELHAMENTO PARA AQUISIÇÃO DE COTAS DESTES FUNDOS. LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. RENTABILIDADE BASEADA NO PRESENTES GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO.

R\$ 3.000.000,00





▶ 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:

29/12/2017

(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

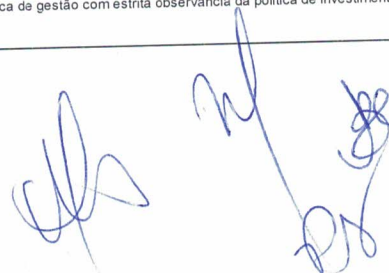
Seção 3 – Resumos Profissionais

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

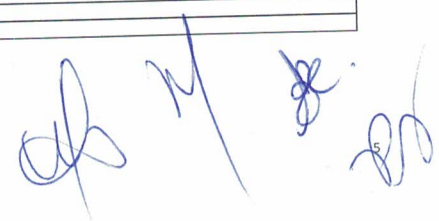


1) Informações sobre o Fundo de Investimento

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		
	42768-3		
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)		
	104.0238.050.00001987.0		
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).		
	PriceWaterhouseCoopers		
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	16:00
	Carência/Tempo mínimo para permanência (<i>lock-up period</i>) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	Não há	
	Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	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 (<i>upfront fee</i>)		
	N/A		
1.21	Taxa de Saída (<i>redemption fee</i>)		
	N/A		
1.22	Taxa de Administração		
	0,20%		
1.23	Taxa de Administração máxima		
	0,40%		
1.24	Taxa de Performance		Não Possui
	%		Não Possui
	Benchmark		Não Possui
	Frequência		Não Possui
	Linha-d'água		Não Possui
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?		
	0,25%		
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 superar o IPCA. Aplica em cotas de fundo de investimento com estratégia balanceada entre fundos que possuem como benchmark os sub índices: IMA-B, IMA-B5, IMA-B5+, IRF-M, IRFM-1, IRFM 1+ e CDI. A carteira é composta por fundos da Caixa já existentes com esses benchmarks		
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.		
<p>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.</p>			
2.1.5	Cite as premiações, ratings e rankings.		
<p>Revista Exame 2004 - 2º lugar Categorias Fundos de Investimento e Fundos de Renda Fixa 2005 - Melhor Gestor de Varejo, Melhor Gestor de Atacado e Melhor Gestor de Renda Fixa 2006 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Varejo, Megafundos e Melhor Gestor de Atacador 2007 - Melhor Gestor de Renda Fixa, Melhor Gestor de Varejo e Melhor e Melhor Gestor de Megafundos 2008 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa 2009 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Renda Fixa Gestão Ativa 2010 - Melhor Gestor de Fundos de Varejo e Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2011 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Varejo e 3º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa Ativa 2012 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Varejo 2013 - Melhores Fundos de Renda Fixa 2014 - Onde investir em 2014 - Os melhores Gestores 2015 - Onde investir em 2015 - Os melhores Gestores</p> <p>Ranking Top Asset 2017 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração</p> <p>Revista Investidor Institucional 2013 - 1º Lugar Gestão de Fundos Multimercado 2014 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2015 - A CAIXA, também, foi eleita uma das maiores gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset - Agosto 2015, realizado pela revista Investidor Institucional. Conquistou a posição de maior gestora em três categorias: • Maior Gestor de Carteiras Administradas; • Maior Gestor de FIPs; • Maior Gestor de RPPS. 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais</p> <p>Rating Fitch Rating - "Forte"</p> <p>Ranking 2.2 - Equipe de Gestão do Fundo</p>			
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).		
<p>SUPERINTENDÊNCIA NACIONAL DE GESTÃO DE ATIVOS DE TERCEIROS Sergio Henrique Oliveira Bini GEVAR - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Camilo de Lellis Cavalcanti Junior GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Fabiano Penna Zimmermann</p>			
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.		
<p>Alteração do Superintendente Nacional - assume Sergio Henrique Oliveira Bini (Gerente Nacional da GEICO) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume Fabiano Penna Zimmermann (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável - assume Camilo de Lellis Cavalcanti Júnior (Gerente Executivo da GEFIX)</p>			
2.3 - Estratégias e Carteiras			
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:		
	Brasil (exclusivamente)	<input checked="" type="checkbox"/>	
	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?		
	N/A		
2.3.5	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
	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	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):	S
3 - Informações Adicionais			
3.1	PL atual		
	685.593.312,38		
3.2	PL médio em 12 meses		
	357.129.791,10		



3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa	
30.702.839.027,30		
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?	
N/A		
3.5	Número de cotistas	
114		
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	
29,42% e 46,92%		
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 VITER 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 resgates 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 líquido. 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 colização. 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 apreamento é realizado considerando as informações 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 VITER - 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	676.918
VaR	6 meses	727.199
VaR	12 meses	835.394
VaR	24 meses	754.654
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nomenclatura 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	-15.367.443
Stress	6 meses	-12.997.325
Stress	12 meses	-12.258.844
Stress	24 meses	-10.534.916
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
2.				
3.				
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)			Contribuição (%)	
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?			
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 <i>conference calls</i> 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, <i>prime broker</i> , 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





Análise de Fundo de Investimentos

DATA: 19/07/2018

Formulário de análise de fundos de investimentos regulamentados pela instrução normativa CVM nº 555. Contempla instituições; enquadramentos legais perante a resolução CMN nº 3922, alterada pela instrução CMN nº 4604; análise de riscos e vedações da resolução supracitada.

COTISTA: Fazprev

CNPJ: 05.145.721/0001-03

FUNDO Caixa FI Ações Institucional BDR NÍVEL I	CNPJ 17.502.937/0001-68
---	----------------------------

INSTITUIÇÕES	
GESTOR Caixa Econômica Federal	CNPJ 00.360.305/0001-04
ADMINISTRADOR Caixa Econômica Federal	CNPJ 00.360.305/0001-04
CUSTODIANTE Caixa Econômica Federal	CNPJ 00.360.305/0001-04

ENQUADRAMENTO	
TIPO ATIVO Artigo 8º, Inciso II, "B"	ENQUADRAMENTO PL DO GESTOR R\$ 14.760.884.500,00 (Ranking Anbima mai/18)
ENQUADRAMENTO ATIVO R\$ 32.926.361,19	ENQUADRAMENTO PASSIVO R\$ 31.680.861,08
VEDAÇÕES RES. CMN 3.922/4.604	<input checked="" type="checkbox"/> 15% do PL:
<input checked="" type="checkbox"/> FUNDO não alavancado (Art. 23, I)	<input type="checkbox"/> 5% do PL:
<input checked="" type="checkbox"/> FUNDO não aplica em FIDC-NP (Art. 23, III)	<input checked="" type="checkbox"/> ENTE não possui títulos ou afins emitidos no fundo (Art. 23, II)
<input checked="" type="checkbox"/> FUNDO está previsto na resolução (Art. 23, V)	<input checked="" type="checkbox"/> FUNDO não pratica day-trade nas modalidades previstas (Art. 23, IV)
	<input checked="" type="checkbox"/> FUNDO enquadrado para investidores qualificados e/ou profissionais, se o RPPS atender a esses critérios (Art. 23, VII)

ANÁLISE DE RISCOS	
CRÉDITO PRIVADO	<input type="checkbox"/> Sim, com limite máximo de aplicação do fundo em XX% <input checked="" type="checkbox"/> Não
LIQUIDEZ	CARÊNCIA <input type="checkbox"/> Sim. Prazo: <input checked="" type="checkbox"/> Não.
	COTIZAÇÃO DE RESGATE: D+1
	LIQUIDAÇÃO DE RESGATE: D+4
MERCADO	<input checked="" type="checkbox"/> inferior a 75% à do indexador.
	INDEXADOR: IBOVESPA
	RISCO INDEXADOR:
	<input type="checkbox"/> entre 75% e 125%.
	<input type="checkbox"/> acima de 125%

TAXAS	
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,70%	TAXA DE GESTÃO: 0,00%
TAXA DE INGRESSO: 0,00%	TAXA DE PERFORMANCE: 0,00%

PARECER TÉCNICO

O FUNDO está enquadrado na Res. CVM no Art. 8º, II, "B". Pode receber recursos até o valor de R\$ 31.680.861,08, sendo este o critério mais restritivo em termos de enquadramentos apontados na Res. e ref. a Política de Investimentos do RPPS. O regulamento do fundo descreve as vedações impostas pela Resolução. O FUNDO possui uma rentabilidade (+38,09%) superior ao seu indexador - Ibovespa (+19,87%), nos últimos 12 meses. O FUNDO possui risco de mercado (volatilidade 12m) inferior (+14,67%), de seu indexador - Ibovespa (+18,74%). O FUNDO possui regras de resgate compatíveis com a sua classe, havendo a liquidação de resgate em até 4 dias úteis após a solicitação de resgate. O FUNDO está apto para o recebimento de recursos.

DISPOSIÇÕES FINAIS

A AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA, denominada CONSULTORIA, é autorizada pela Comissão de Valores Mobiliário (CVM), com especialidade no segmento previdenciário e institucional. Através do Ato Declaratório de nº 14.576, de 20 de outubro de 2015, o Superintendente de Relações com Investidores Institucionais da Comissão de Valores Mobiliários, no uso da competência que lhe foi delegada pela Deliberação CVM nº 158, de 21/07/93, autoriza a AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA, C.N.P.J. nº 22.863.573/0001-81, a prestar os serviços de Consultor de Valores Mobiliários, previstos no artigo 27 da lei nº 6.385/76, de 07 de dezembro de 1976. Assim como, os serviços prestados e informações passadas referente à consultoria de valores mobiliários, não garante resultados futuros ou a isenção de risco para com o investidor.

As informações divulgadas aqui têm caráter meramente informativo, não se constituindo em oferta de venda de fundos de investimentos. A CONSULTORIA não comercializa nem distribui quotas de fundos de investimentos ou qualquer outro ativo financeiro. As informações aqui contidas foram produzidas pela CONSULTORIA dentro das condições atuais de mercado e conjuntura, sendo que todas as recomendações e estimativas aqui apresentadas derivam de nosso julgamento e podem ser alteradas a qualquer momento sem aviso prévio. Ressaltamos que rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura e a rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. As informações deste site são exclusivamente informativas. Recomendamos ao investidor a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento dos fundos de investimento ao aplicar seus recursos. Ressaltamos que os fundos de investimentos não contam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. A CONSULTORIA não se responsabiliza por decisões de investimento tomadas com base nos dados aqui divulgados.

Fale Conosco
Rua Nereu Ramos, 942, Sala 301
Jardim Blumenau - Blumenau - SC
CEP: 89010-401
Fone: (48) 3232-2290
contato@amxcapital.com.br



Sugestão: R\$ 200.000,00

Material de Divulgação
17.502.937/0001-68
Informações referentes a abr/18

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Público Alvo:

O FUNDO destina-se a pessoas físicas e jurídicas, investidores Institucionais, Fundos de Investimento e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento, previamente cadastrados perante a ADMINISTRADORA, dispostas a obter valorização de suas cotas por meio da aplicação de recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras, negociados no Brasil, buscando uma rentabilidade diferenciada mediante alocação nesses ativos.

Objetivo e Política de Investimento:

Oferecer um Fundo da Categoria Ações Livre às Pessoas Físicas e Jurídicas da CAIXA, que buscam retornos diferenciados por meio da aplicação de, no mínimo 67% do patrimônio em ativos de renda variável, preponderantemente, em BDR Nível I.

Demais Observações:

PARÂMETROS DO FUNDO

Taxa de Administração	0,70%	Classificação ANBIMA	Ações Livre***
Aplicação Inicial	10.000,00	Data Início	24/06/13
Aplicações Adicionais	500,00	Aplicação (déb./conv.)	D0 / D1***
Resgate Mínimo	500,00	Resgate (conv./créd.)	D1 / D4***
Saldo Mínimo	5.000,00	Cota Utilizada	Fechamento
Liquidez	Diária	Classificação de Risco	Arrojado
Horário Permitido	17:00*		

* Horário de Brasília

***Dias úteis contados após a data de solicitação.

****Descrição do tipo Anbima disponível no Formulário de Informações Complementares

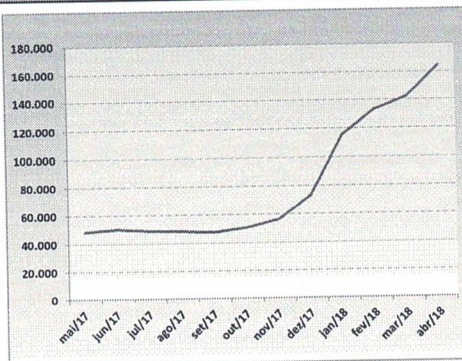
INFORMAÇÕES DE RISCO

Volatilidade no ano ⁽¹⁾	16,1558%	Volatilidade nos últimos 12 m ⁽¹⁾	14,2796%
Tracking error no ano ⁽²⁾	0,2677	Tracking error nos 12 m ⁽²⁾	2,9831
% retornos positivos no ano	53,66%	% retornos positivos últimos 12 m	52,40%
Índice de Sharpe no ano ⁽³⁾		Índice de Sharpe nos 12 m ⁽³⁾	

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Tecnologia da Informação	27,17%
Financeiro e Outros	21,39%
Consumo Cíclico	14,29%
Saúde	12,93%
Consumo não Cíclico	7,44%
Petróleo, Gás e Biocombustíveis	5,81%
Bens Industriais	5,55%
Telecomunicações	2,80%
Cotas de Fundos	1,50%
Materiais Básicos	0,72%
Outros	0,39%

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL (R\$ mil)



Patrimônio Líquido em 30/04/18

164.475.034,35

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO - 12 MESES

81.597.983,90

Regulamentação:

Instrução CVM 555/14 e alterações posteriores
Regulamento e Lâmina de Informações Essenciais disponíveis no site da CAIXA: www.caixa.gov.br
Portal de educação financeira da ANBIMA - Como Investir: www.comoinvestir.com.br

Administrador:

Gestor:

Distribuidor:

Custodiante:

Auditor:

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes

Atendimento ao Cotista:

As informações sobre o Fundo poderão ser consultadas:

I - Diretamente nas Agências e/ou PABs

II - Pela "Internet" nos endereços eletrônicos:

a) www.caixa.gov.br

III - SAC: 0800 726 0101

IV - Ouvidoria Caixa: 0800 725 7474

V - Atendimento a pessoas com deficiência auditiva: 0800 862 2492

Supervisão e Fiscalização

Comissão de Valores Mobiliários - CVM

Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.

RENTABILIDADE

Ano	Fundo	BDRX	% Bench
2013	15,547%	23,085%	67,35%
2014	21,241%	28,089%	75,62%
2015	49,186%	52,290%	94,06%
2016	-10,805%	-9,706%	-
2017	22,808%	24,071%	94,75%

Mês	Fundo	BDRX	% Bench
mai/17	2,929%	3,060%	95,74%
jun/17	3,320%	3,864%	85,92%
jul/17	-4,269%	-4,083%	-
ago/17	1,239%	1,112%	111,47%
set/17	1,580%	1,661%	95,14%
out/17	6,119%	6,223%	98,32%
nov/17	1,880%	2,064%	91,08%
dez/17	4,167%	4,354%	95,70%
jan/18	1,558%	1,637%	95,13%
fev/18	-1,416%	-1,260%	-
mar/18	-2,727%	-2,653%	-
abr/18	6,762%	6,985%	96,81%
Ano	3,975%	4,518%	87,99%
12 Meses	22,596%	24,796%	91,13%

Para o cálculo da rentabilidade é utilizada a cota do último dia útil do mês.
*A utilização do BDRX11 para comparativo da rentabilidade é mera referência econômica e não parâmetro de objetivo do Fundo.



(1) Grau médio de variação da cota do fundo

(2) Grau médio de variação da cota do fundo em relação ao Benchmark

(3) Índice que tem por objetivo ajustar o retorno do fundo pelo seu risco, ou seja, quanto maior o retorno e menor o risco do fundo, melhor será seu índice de Sharpe. Índices com valores menores que zero não têm significado interpretativo, por isso não serão divulgados.

Fonte: SISFIN, ANBIMA, ECONÔMICA, BACEN, BM&FBOVESPA.

TRIBUTAÇÃO

[5] Incidir, por ocasião do resgate, imposto de renda na fonte sobre os rendimentos auferidos pelo Fundo, à alíquota de 15% (quinze por cento).

Aos cotistas isentos ou imunes não incidirá tributação, mediante apresentação de documento que comprove a situação