



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS N º 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N º 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	039 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	039 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	22/02/2019
CNPJ: 05.244.336/0001-13		
Valor:		
R\$ 40.000.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Quarenta milhões de reais		

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRE-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		
CNPJ do Fundo:	10.740.670/0001-06		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 40.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	16.746.987,40310820		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,38849		
Data da Operação:	22/02/2019		
Data de Liquidação:	22/02/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	16.174.080.430,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		0,247%	
Limite Máximo por PL do fundo		15,00%	
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004 5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30/10/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS		R\$ 71.908.898.780,00	
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.		17,75%	
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30/10/2018		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	70.541.360.508,25	
% Recursos do Gestor com RPPS		20,77%	
Empresa de Rating		Fitch Ratings	
Conceito		Forte	
Representação do conceito		Muito bom	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018		

Data de Início FI:		28/05/2010
Taxa Administração do FI (%):		0,20
Índice de Referência do FI:		IRFM 1
Tx Performance do FI (%):		Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):		Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):		Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Dispensado
Carência (dias):		0 dias
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		0
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não
CNPJ do Fundo:		0,00
Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Renda Fixa de Mercado 1 - IRFM 1, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA
	Principais riscos do fundo:	O Cotista está sujeito aos riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos. Existe a possibilidade de ocorrer redução da rentabilidade ou mesmo perda do capital investido no FUNDO, em decorrência dos riscos constantes no regulamento do fundo. (Risco: 2)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Baixo
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Curto Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		0,83%
Retorno Médio Anual		10,48%
Retorno Total		123,85%

Maior Retorno		1,62%
Menor Retorno		0,19%
Qtde. mês Positivo		97
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		12
Qtde. mês abaixo do Benchmark		85
Risco Mensal Período		0,27%
Risco Mensal 12 MESES		0,17%
Risco Anual do Período		0,92%
Retorno Relativo ao Benchmark		-1,44%
Sharpe		0,26
Information Ratio		-4,15
Tracking Error		0,05%
VAR HISTÓRICO (95%)		1,27%
VAR 12 MESES (95%)		0,99%
Sharpe Modificado		1,25
Beta (12 meses)		0,96
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,02%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	20/02/2019
Outras Observações:		
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a" ; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, VII, "a"		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 8º, IV, "a"		
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo	

O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
Fundo:	CAIXA BRASIL IDCA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO
CNPJ do Fundo:	14.386.926/0001-71
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos Art. 7º, I, "B"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 40.000.000,00
Quantidade de Cotas:	19.697.941.909/8440
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,03067
Data da Operação:	22/02/2019
Data de Liquidação:	22/02/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$)	R\$ 8.147.828.950,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,491%
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal 50-7 00000004 5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30/10/2018
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 71.908.898.780,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	17,75%
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30/10/2018
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 70.541.460.508,21
% Recursos do Gestor com RPPS	20,77%
Empresa de Rating	Fitch Ratings
Conceito	Forte
Representação do conceito	Muito bom
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	Sim
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018
Data de Início FI:	16/08/2012
Taxa Administração do FI (%):	0,20
Índice de Referência do FI:	IDCA IPCA 2A
Tx Performance do FI (%):	Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx performance será cobrada ou não):	Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance



Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	0	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	0,00	
Segmento:	R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:	0,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Duração Constante ANBIMA - segmento IPCA 2A (IDCA IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA
	Principais riscos do fundo: Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de mercado, de crédito e diversos outros Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior

Retorno Médio Mensal	0,84%
Retorno Médio Anual	10,48%
Retorno Total	123,85%
Maior Retorno	1,62%
Menor Retorno	0,19%
Qtde. mês Positivo	97
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	12
Qtde. mês abaixo do Benchmark	85
Risco Mensal Período	0,27%
Risco Mensal 12 MESES	0,17%
Risco Anual do Período	0,92%
Retorno Relativo ao Benchmark	-1,44%
Sharpe	0,26
Information Ratio	-4,15
Tracking Error	0,05%
VAR HISTÓRICO (95%)	1,27%
VAR 12 MESES (95%)	0,99%
Sharpe Modificado	1,25
Beta (12 meses)	0,96
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,02%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos: 20/02/2019
Outras Observações:	

Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco

Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"

Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantém a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
 PROPONENTE Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Unidade de Investimentos CFI 05.2430.264/25 Entidade Certificadora: ANBIMA CFA 10 e CFA Validade da Certificação: 05/12/2020	 GESTOR/AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CFI 33.0328.354/00 Entidade Certificadora: ANBIMA CFA 20 e CFA Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 22 de fevereiro de 2019

**RECI
PREV**

Ofício RECI PREV nº 039/2019 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 40.000.000,00 (Quarenta milhões de reais), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 10.740.670/0001-06 e aplicar o mesmo valor no FUNDO CAIXA IDKA IPCA 2 A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 039/2019

Atenciosamente,

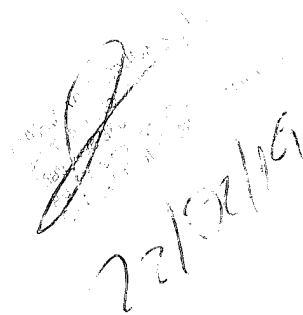


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
DIRETOR VICE PRESIDENTE

Ilma Senhora
MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA



Características

CNPJ: 10.740.670/0001-06
 Gestor: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classe de Ação: Anúncio: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 248975
 Início do Fundo: 28/05/2010

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

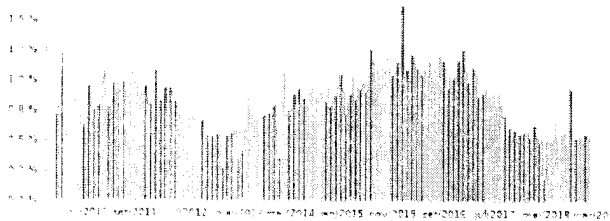
Retorno (%)	Jan/10	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	138,85	0,93	6,73	17,40	33,90	0,57	0,54	0,53	0,94	0,59	0,41	0,68	0,50	0,19	0,49	0,64	0,53
% do CDI	103,38	99,26	104,97	107,40	104,73	104,58	109,89	107,05	172,19	125,77	71,69	126,06	95,92	37,07	94,28	120,24	114,81
CDI	134,31	0,94	6,41	16,20	32,37	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46
Ibovespa	58,02	11,38	12,92	44,00	136,00	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52
IBX	107,64	11,21	13,74	45,22	132,90	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42
IGPM	67,62	0,36	7,07	6,63	12,87	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezeza Anual do Benchmark
Fundo	2.38849	16.174.080,43	17.594.076,29	0,55%	-0,34%	0,26%	0,05	0,55%	0,94%	0,19%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

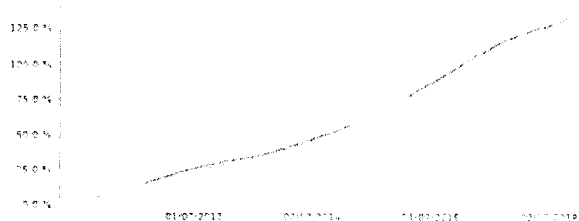
Gráficos

☐ Fundo ☒ CDI

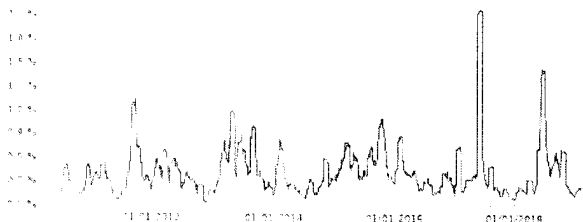
Retorno Mensal - 31/05/2010 a 22/02/2019 (mensal)



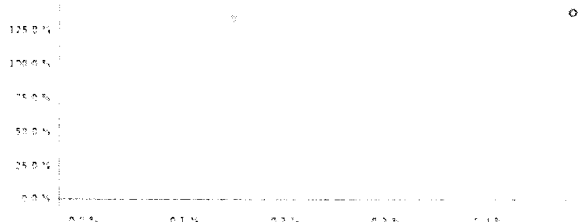
Retorno Acumulado - 31/05/2010 a 22/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 31/05/2010 a 22/02/2019 (diária)



Risco x Retorno - 31/05/2010 a 22/02/2019 (diária)

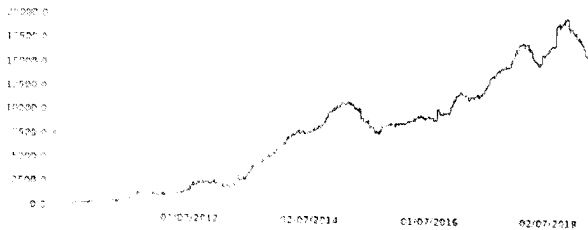


Este relatório contém informações sobre o desempenho dos títulos públicos e privados considerados confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade dos dados é da Caixa Econômica Federal (CAIXA). Não há garantia de que os dados aqui apresentados sejam precisos e completos. As informações disponíveis não devem ser interpretadas como recomendação ou sugestão de investimento. O rendimento do fundo pode variar significativamente dependendo das estratégias adotadas pelo gestor. O fundo não é garantido e pode sofrer perdas. Para mais informações, consulte o site da Caixa Econômica Federal ou o site do fundo. Este relatório não constitui oferta de investimento em qualquer forma. Para mais informações, consulte o site da Caixa Econômica Federal ou o site do fundo.

CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

22/02/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2010 a 22/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 31/05/2010 a 22/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

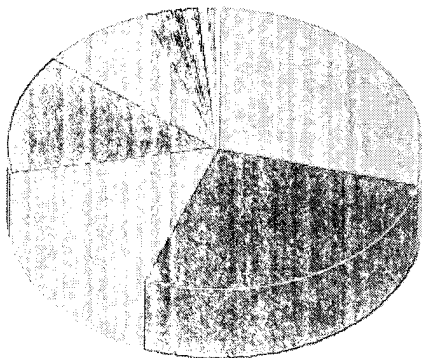
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PI Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18
Operações Compromissadas	80,04%	48,64%	65,57%	85,51%	65,95%	55,90%	74,02%	60,09%
Títulos Públicos	19,94%	51,36%	34,44%	14,49%	34,06%	44,07%	25,97%	39,91%
Moedas Futuro - Posições compradas	0,02%	0,00%	0,00%	0,01%	0,01%	0,03%	0,01%	0,00%
Valores a receber	0,02%	0,00%	0,00%	0,01%	-	0,03%	0,01%	0,01%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	0,01%	-0,00%	0,00%	-0,00%
Moedas Futuro - Posições vendidas	-	-	-	-	-	-	-	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	17.170.876,64	18.338.157,57	18.654.905,88	19.282.041,34	19.832.435,94	19.599.360,38	17.302.996,88	16.969.571,24
Data da Divulgação	04/02/2019	07/01/2019	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018	05/09/2018	08/08/2018	09/07/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2019



Operações Compromissadas - LTN - Venc 01/07/2020	28,81%
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc 01/01/2023	26,71%
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc 15/08/2022	15,96%
LTN - Venc 01/10/2019	14,23%
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc 01/01/2025	9,57%
LFT - Venc 01/03/2020	1,47%
LFT - Venc 01/03/2019	0,84%
LTN - Venc 01/01/2020	0,71%
LTN - Venc 01/07/2019	0,68%
LFT - Venc 01/03/2021	0,58%
LFT - Venc 01/03/2022	0,32%
LFT - Venc 01/03/2024	0,29%
LFT - Venc 01/09/2021	0,25%
LFT - Venc 01/09/2020	0,25%
LFT - Venc 01/09/2022	0,23%
LFT - Venc 01/03/2023	0,09%
Outros Valores a receber	0,02%
Mercado Futuro - Posições compradas - DIFLITF20	0,02%
Lançamentos positivos menores que 0,02%	0,00%

As informações aqui divulgadas são de caráter informativo e não representam recomendações de investimento. A Caixa não se responsabiliza por qualquer perda decorrente da utilização das informações aqui divulgadas. Os dados aqui divulgados são de caráter informativo e não representam recomendações de investimento. A Caixa não se responsabiliza por qualquer perda decorrente da utilização das informações aqui divulgadas. Os dados aqui divulgados são de caráter informativo e não representam recomendações de investimento. A Caixa não se responsabiliza por qualquer perda decorrente da utilização das informações aqui divulgadas.

Características

CNPJ: 14.386.926/0001-71
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administração: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anômala: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 310638
 Início do Fundo: 16/08/2012

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

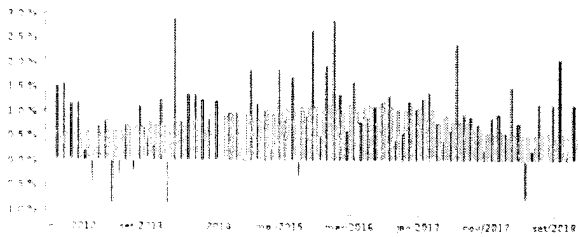
Retorno (%)	Inicio	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	maio/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundi	103,07	1,75	9,79	22,65	37,97	1,27	1,16	0,13	2,08	1,15	0,01	1,19	0,21	-0,79	0,78	1,52	0,57
CDI (CDI)	118,14	186,61	152,69	139,79	117,27	233,13	234,65	26,83	383,90	246,16	0,92	219,34	40,19	-152,36	151,38	285,19	121,83
CDI	87,24	0,94	6,41	16,20	32,37	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46
Boverpa	64,67	11,38	12,92	44,00	136,00	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	10,87	0,88	0,01	0,52
IBX	90,21	11,21	13,74	45,22	132,90	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	10,91	0,82	0,08	0,42
IGPM	42,44	0,36	7,07	6,63	12,87	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Desv. Área do Benchmark
Fundi	2.030669	8.147.828,95	6.044.667,94	2,36%	-2,35%	1,12%	1,84	2,35%	2,08%	0,79%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

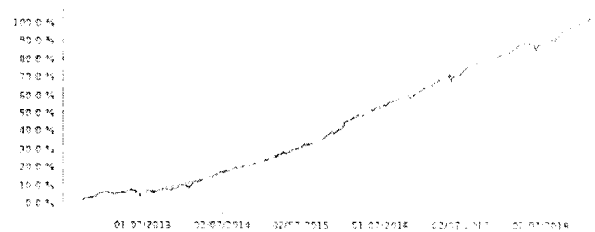
Graficos

□ Fundo ■ CDI

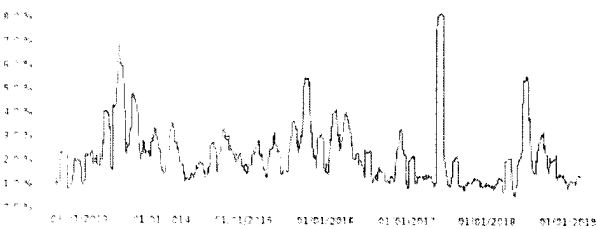
Retorno Mensal - 17/08/2012 a 22/02/2019 (mensal)



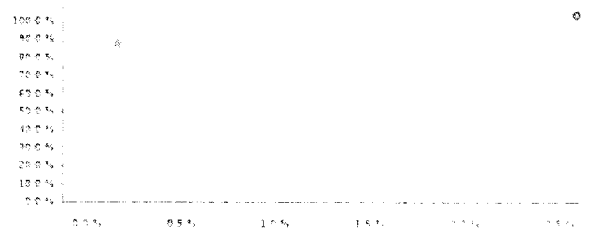
Retorno Acumulado - 17/08/2012 a 22/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/08/2012 a 22/02/2019 (diária)

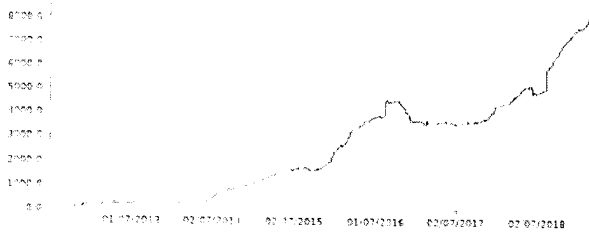


Risco x Retorno - 17/08/2012 a 22/02/2019 (diária)

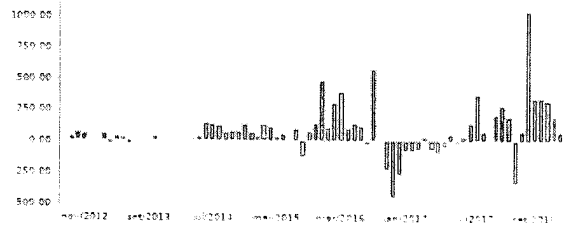


Este fundo investe em títulos emitidos por instituições públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela avaliação e garantia não é assumida pelo IFRB. Devido à natureza de longo prazo, os investimentos de curto prazo em títulos de menor prazo são realizados com o objetivo de melhorar o desempenho. Os dados de investimento não contam com a garantia da Administração do fundo, Gestor da carteira, da Caixa Econômica Federal ou de qualquer outra instituição financeira. A volatilidade da renda do fundo não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com recursos alavancados como opção de política de risco do fundo podem ocasionar perdas significativas para os investidores caso haja uma redução na capitalização do fundo de investimento do qual o fundo aplica o recurso. Este fundo não possui garantia de principal e o investidor pode não recuperar o valor investido. Os dados são atualizados até a última data de publicação do relatório de fundo de investimento do qual o fundo aplica o recurso. Este fundo não possui garantia de principal e o investidor pode não recuperar o valor investido. Este fundo não possui garantia de principal e o investidor pode não recuperar o valor investido. Este fundo não possui garantia de principal e o investidor pode não recuperar o valor investido.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 22/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 22/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

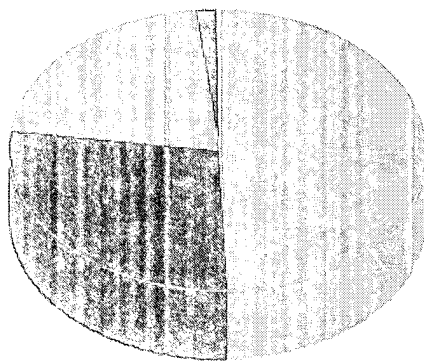
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PI Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18
Títulos Públicos	98,29%	98,19%	97,81%	97,83%	98,10%	97,30%	98,34%	99,56%
Operações Compromissadas	1,71%	1,82%	2,19%	2,17%	1,91%	2,71%	1,67%	0,44%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidade	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7 762 559,32	7 593 758,54	7 304 520,06	6 974 089,25	6 494 582,56	6 077 575,26	5 028 426,83	4 897 194,28
Data da Divulgação	04/02/2019	07/01/2019	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018	05/09/2018	06/08/2018	09/07/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2019



NTN-B - Venc 15/08/2020	49,21%
NTN-B - Venc 15/05/2021	27,71%
NTN-B - Venc 15/08/2022	21,22%
Operações Compromissadas - LTN - Venc 01/10/2019	1,71%
NTN-B - Venc 15/05/2019	0,13%
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,06%
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,06%
Valores a pagar / Taxa Selic	0,06%
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,06%
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,06%
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,06%
Outras Disponibilidades	0,06%

As informações foram elaboradas pela CAIXA Previdência Investimentos e Fundos de Investimentos em Valores Mobiliários, com responsabilidade pela elaboração e geração das informações e divulgação por meio do site www.caixa.com.br. Estas informações são para fins informativos e não constituem recomendação de investimento. A CAIXA não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso das informações aqui apresentadas. A CAIXA não garante a atualidade, a exatidão ou a integridade das informações aqui apresentadas. A CAIXA não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso das informações aqui apresentadas. A CAIXA não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso das informações aqui apresentadas.