



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 Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 Valor: R\$ 76.695,27 Setenta e seis mil, seiscentos e noventa e cinco reais e vinte e sete centavos	Nº / ANO:	123 /2019 - GI
	OF. Nº:	123 /2019 - GI
	Data:	13/05/19
	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a" Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANFAMENTO		
CNPJ do Fundo:	19.542.287/0001-00		
Segmento:	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior		
Tipo de Ativo:	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 76.695,27		
Quantidade de Cotas:	110,44300890		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 694,43300		
Data da Operação:	13/05/2019		
Data de Liquidação:	13/05/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	166.663.920,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,046%		
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%		
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\$ 72.705.798.060,00		
% 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.	17,71%		
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\$	71.351.517.620,00	
% Recursos do Gestor com RPPS	20,58%		
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:		23/01/2014
Taxa Administração do FI (%):		0,45%
Índice de Referência do FI:		IPCA + 11,90%
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:		Fitch Ratings
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		BB+
Carência (dias):		28/02/2019
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		0
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR QUALIFICADO
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 Fundo é uma comunhão de recursos destinados, preponderantemente, à aquisição de Direitos Creditórios, de acordo com a Política de Investimento descrita no Capítulo Seis do Regulamento.
	Principais riscos do fundo:	Os Direitos Creditórios Cedidos e os Ativos Financeiros, por sua própria natureza, estão sujeitos a diversos riscos, incluindo, mas não se limitando a flutuações de mercado e/ou a riscos de crédito das respectivas contrapartes que poderão gerar perdas ao Fundo e aos Cotistas, bem como os demais riscos contantes do regulamento do fundo. (Risco: 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
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		1,26%
Retorno Médio Anual		16,24%
Retorno Total		109,55%

Maior Retorno	2,77%
Menor Retorno	0,05%
Qtde. mês Positivo	59
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	24
Qtde. mês abaixo do Benchmark	35
Risco Mensal Período	0,35%
Risco Mensal 12 MESES	0,30%
Risco Anual do Período	1,21%
Retorno Relativo ao Benchmark	-1,73%
Sharpe	4,62
Information Ratio	0,35
Tracking Error	1,18%
VAR HISTÓRICO (95%)	1,83%
VAR 12 MESES (95%)	1,80%
Sharpe Modificado	15,42
Beta (12 meses)	-0,16
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,34%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de 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 RFCIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 23/04/2019
Outras Observações:	Amortização/Juros
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?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
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?	Sim
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Sim
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Não comprovado
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Não
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Sim
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

Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		
CNPJ do Fundo:	11.060.913/0001-10		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos Art. 7º, I, "E"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 76.695,27		
Quantidade de Cotas:	27.662.517.393.81		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,77253		
Data da Operação:	13/05/2019		
Data de Liquidação:	13/05/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	9.640.930.830,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,001%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONÔMICA 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\$ 72.705.798.060,00		
% 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.	17,71%		
Gestor:	CAIXA ECONÔMICA 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\$	71.353.527.620,04	
% Recursos do Gestor com RPPS	20,58%		
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 BACDEN	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONÔMICA 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:	IMA B 5		
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 anual. 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 subíndice do Índice de Mercado ANBIMA série B 5 - IMA B 5, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O prazo médio da carteira do FUNDO será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. É vedada ao FUNDO a aplicação de recursos em cotas de fundos de investimento, de qualquer modalidade.
	Principais riscos do fundo:	O cotista está sujeito aos seguintes riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos: Risco de mercado, variação dos preços e cotações de mercado dos ativos que compõem a carteira do FUNDO e os demais riscos constantes do regulamento do fundo. (Risco 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	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	1,26%
Retorno Médio Anual	16,24%
Retorno Total	109,55%
Maior Retorno	2,27%
Menor Retorno	0,05%
Qtde. mês Positivo	59
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	24
Qtde. mês abaixo do Benchmark	35
Risco Mensal Período	0,35%
Risco Mensal 12 MESES	0,30%
Risco Anual do Período	1,21%
Retorno Relativo ao Benchmark	1,73%
Sharpe	4,62
Information Ratio	0,35
Tracking Error	1,18%
VAR HISTÓRICO (95%)	1,83%
VAR 12 MESES (95%)	1,80%
Sharpe Modificado	15,42
Beta (12 meses)	-0,16
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,34%

Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS: Sim, porém, não há necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate.

Análise / Parecer do Conselho Municipal de Providência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RFI (IPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações)	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	23/04/2019
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)		
 PROPONENTE	 GESTOR/AUTORIZADOR	



Anderson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF 092.430.264-25

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação 05/12/2020



José Marcos Alves de Barros

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF 334.326.454-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação 21/11/2021

Recife, 13 de maio de 2019

Ofício RECIPREV nº 123/2019 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 76.695,27 (Setenta e seis mil, seiscentos e noventa e cinco reais e vinte e sete centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 11.060.913/0001-10; vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 123/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

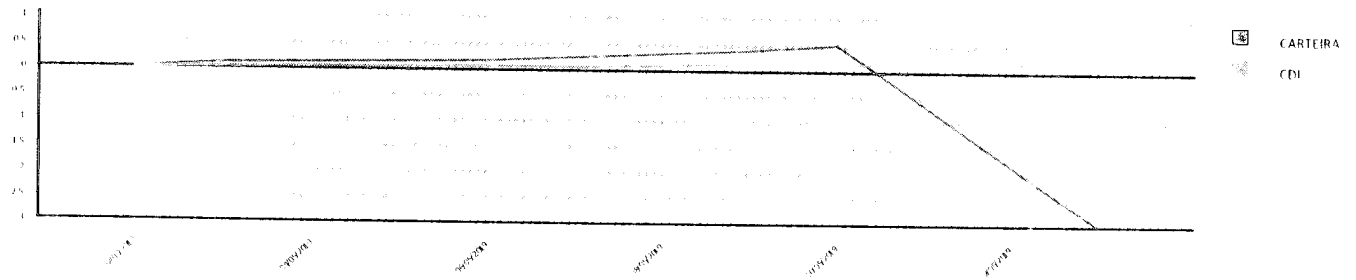
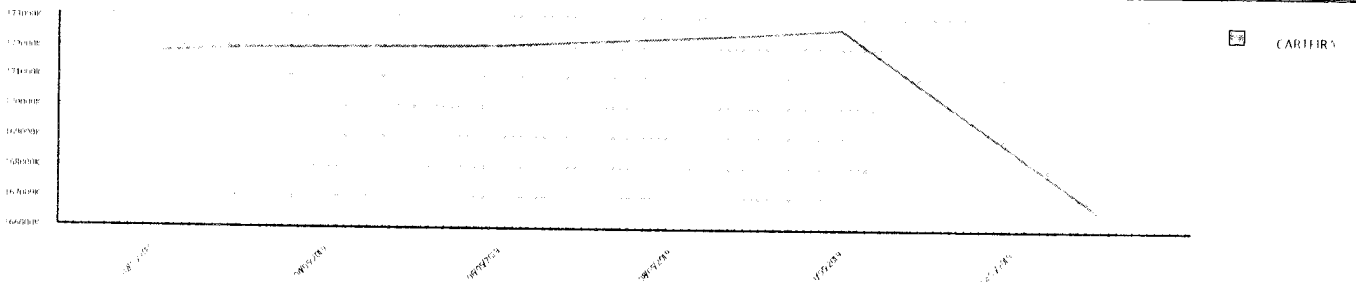


ELCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

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

J
13/05/19

Data	Patrimônio Líquido	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Rentabilidade Dia		Rentabilidade Acumulada		% Sobre Ind
				%Carteira	% Indexador	% Carteira	% Indexador	
COTA SENIOR								
02/05/2019	171.787.165,20	240.000,00000000	715,77985500	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
03/05/2019	171.931.426,56	240.000,00000000	716,38094400	0,08	0,02	0,08	0,02	341,09
06/05/2019	172.075.809,12	240.000,00000000	716,98253800	0,08	0,02	0,17	0,05	341,19
07/05/2019	172.220.313,12	240.000,00000000	717,58463800	0,08	0,02	0,25	0,07	341,29
08/05/2019	172.364.938,32	240.000,00000000	718,18724300	0,08	0,02	0,34	0,10	341,40
09/05/2019	172.509.684,96	240.000,00000000	718,79035400	0,08	0,02	0,42	0,12	341,50
10/05/2019	172.654.553,28	240.000,00000000	719,39397200	0,08	0,02	0,50	0,15	341,60
13/05/2019	166.663.920,00	240.000,00000000	694,43300000	-3,47	0,02	-2,98	0,17	-1.729,21

Evolução da Rentabilidade

Evolução do Patrimônio


:: CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

13/05/2019

Características

CNPJ: 11.060.913/0001-10
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administração: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 251496
 Início do Fundo: 09/07/2010

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

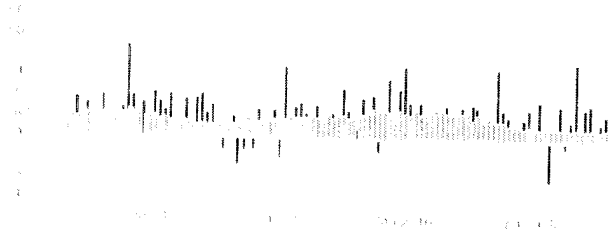
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Fundo	177,35	4,41	10,74	22,76	38,59	1,08	0,76	0,52	1,53	1,38	0,13	3,10	0,86	-0,27	1,46	0,42	-1,59
% do CDI	131,54	197,00	167,88	151,83	126,65	208,01	163,06	106,14	282,28	279,27	27,30	570,35	183,03	-47,67	269,61	81,30	-306,67
CDI	134,75	2,24	6,40	14,99	30,47	0,52	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,51
Ibovespa	44,51	4,37	8,85	39,60	74,54	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87
IRx	91,62	4,89	10,39	40,52	76,98	1,06	0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	1,23	-3,13	8,84	5,19	10,01
IGP-M	70,81	3,25	8,39	11,06	14,48	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2.772534	9.640.930,83	8.695.718,87	3,06%	-2,77%	1,45%	4,40	3,06%	3,10%	-0,27%	8
CDI				0,00%		0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

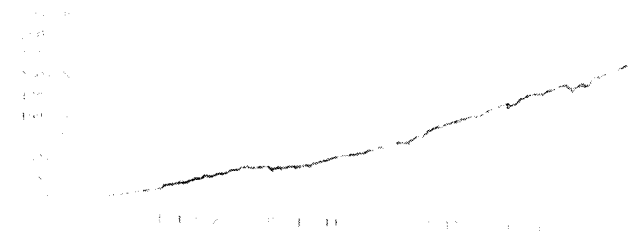
Gráficos

□ Fundo ■ CDI

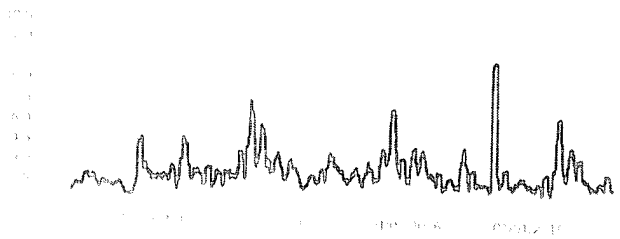
Retorno Mensal - 12/07/2010 a 13/05/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 12/07/2010 a 13/05/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 12/07/2010 a 13/05/2019 (diária)



Risco x Retorno - 12/07/2010 a 13/05/2019 (diária)



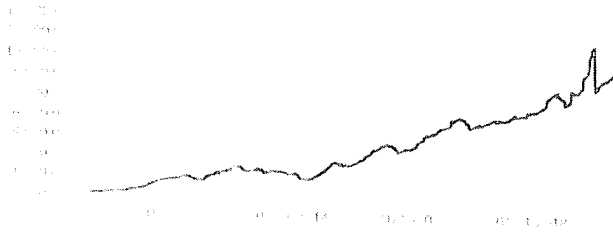
Atendimento ao investidor: 0800 20 11 22. Os valores públicos aqui publicados são meramente informativos e não representam uma recomendação de investimento. Não são uma garantia de retorno. Os valores aqui publicados são meramente informativos e não representam uma recomendação de investimento. Não são uma garantia de retorno. Os valores aqui publicados são meramente informativos e não representam uma recomendação de investimento. Não são uma garantia de retorno.

CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

13/05/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 12/07/2010 a 13/05/2019 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 12/07/2010 a 13/05/2019 (mensal)



Composição da Carteira

abr/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18
Títulos Públicos	96,95%	97,69%	97,90%	96,33%	97,51%	96,39%	89,96%	98,36%
Operações Comprimissadas	3,06%	2,32%	2,10%	3,68%	2,50%	3,62%	10,05%	1,65%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
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%	-0,00%	0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	9.467.101,11	9.063.168,82	9.015.548,85	8.675.733,04	11.498.930,14	9.736.339,71	9.298.896,01	8.106.459,15
Data da Enciculação	07/05/2019	04/04/2019	07/03/2019	04/02/2019	07/01/2019	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018

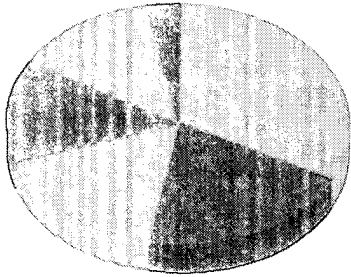
Ver informações detalhadas sobre o fundo em títulos públicos e em valores considerados de baixa risco, cuja responsabilidade é inteiramente do investidor, no site do CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP. As informações aqui divulgadas são meramente informativas e não constituem recomendação de investimento. A CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP não se responsabiliza por danos decorrentes de investimentos realizados no fundo. O fundo não é garantido pelo FGC. Os dados aqui divulgados são de caráter informativo e não devem ser considerados como recomendação de investimento. Os dados aqui divulgados são de caráter informativo e não devem ser considerados como recomendação de investimento. Os dados aqui divulgados são de caráter informativo e não devem ser considerados como recomendação de investimento.

CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

13/05/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

abr/2019



NTN-B - Venc.: 15/08/2022	32.35 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	20.32 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	16.76 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	13.85 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	13.67 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2019	3.06 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0.00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0.00 %
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0.00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0.00 %
Outras Disponibilidades	0.00 %
Outros Valores a receber	0.00 %

A informação sobre a carteira de títulos públicos ou privados disponibilizada aqui refere-se à situação da carteira de valores mobiliários em 13/05/2019. Não há garantia de que as informações aqui apresentadas sejam corretas, completas ou atualizadas. A informação aqui apresentada não deve ser considerada como recomendação de compra ou venda de qualquer produto financeiro ou qualquer outro serviço oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso das informações aqui apresentadas. A Caixa Econômica Federal não garante a liquidez de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante o retorno de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a preservação de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a integridade de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a validade de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a veracidade de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a confiabilidade de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a idoneidade de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a solidez de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a estabilidade de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança jurídica de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança física de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança operacional de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança tecnológica de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança ambiental de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança social de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança econômica de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança política de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança jurídica, física, operacional, tecnológica, ambiental, social, econômica ou política de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal. A Caixa Econômica Federal não garante a segurança de qualquer produto financeiro oferecido pela Caixa Econômica Federal.