



► 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:

31/12/2019

(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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP			
1.2	CNPJ		
11.060.913/0001-10			
1.3	Data de início		
09/07/2010			
1.4	Classificação CVM		
Renda Fixa			
1.5	Classificação ANBIMA		
Renda Fixa Indexados			
1.6	Código ANBIMA		
251496			
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?		
N/A			
1.8	Classificação tributária (CPLP/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)		
104.0238.050.00000209.8			
1.13	Conta CETIP (nº)		
19155.00-1			
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			
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		
Não possui			
1.24	Taxa de Performance		
%		Não possui	
Benchmark		Não possui	
Frequência		Não se aplica	
Linha-d'água		Não se aplica	
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 rentabilidade que acompanhe a variação do IMA-B 5. Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.			
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.		
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 2005 a 2018 - Premiada pela premiação "os melhores fundos de investimento" da revista EXAME por 14 anos consecutivos Ranking ANBIMA 2019 - 4º lugar do Ranking geral de recursos sob Administração Revista Investidor Institucional 2016 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2017 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2018 - Top 10 entre Os Melhores Fundos para Institucionais 2019 - 22 fundos classificados como excelentes no Ranking "Melhores Fundos para Institucionais" TOP ASSET Ranking Top Asset – ABR 19, realizado pela revista Investidor Institucional. Maior Gestora de RPPS Rating Fitch Rating – "Forte" Ranking ANBIMA – 1º lugar em Gestão de Recursos de RPPS (11/2019)			
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 Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré GEVAR – GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL Melchior Vinícius dos Santos Felix GEFIX - GERÊNCIA NACIONAL DE FUNDOS DE RENDA FIXA Carlos Eduardo Biteli			
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.		
Alteração do Superintendente Nacional – assume interinamente Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré (Gerente Nacional da GEVAR) Alteração do Gerente Nacional de Renda Fixa - assume interinamente Carlos Eduardo Biteli (Gerente Executivo da GEFIX) Alteração do Gerente Nacional de Renda Variável- assume interinamente Melchior Vinícius dos Santos Felix (Gerente Executivo da GEVAR)			
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.).		
N/A			
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?		
Não cita.			
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		Não cita	
Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)		Não cita	
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			
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		
9.819.854.122,58			
3.2	PL médio em 12 meses		
9.657.296.839,02			

3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
	65.660.101.434,90
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
	Depende da capacidade de alocação da estratégia ou da eventual falta de liquidez dos ativos em carteira.
3.5	Número de cotistas
	923
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
	23,36% e 30,71%
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 VIART 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 específicos 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 reclassificados 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 decisão no Comitê de Marcação a Mercado.
4.5	Qual(is) 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 VIART – 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 29.897.414
	VaR 6 meses 25.474.605
	VaR 12 meses 20.844.465
	VaR 24 meses 13.731.109
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 -990.323.338
	Stress 6 meses -927.754.150
	Stress 12 meses -729.890.231
	Stress 24 meses -461.890.393
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	Apagação	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)					
7.1	Atribuição			Contribuição (%)	
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

FUNDO

Artigo 1º - O Fundo de Investimento CAIXA Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo, doravante designado, abreviadamente, FUNDO, é um Fundo de Investimento constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, regido pelo presente Regulamento e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis.

Artigo 2º - O FUNDO destina-se a acolher investimentos de Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS instituídos pelos Estados, Municípios e Distrito Federal do Brasil, das Entidades Públicas da Administração Direta, Autarquias, Fundações Públicas, Entidades Fechadas de Previdência Complementar, Fundos de Investimento e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento administrados pela ADMINISTRADORA, Entidades Abertas de Previdência Complementar, Companhias Seguradoras e Sociedades de Capitalização, previamente cadastrados perante ADMINISTRADORA, doravante designados, Cotista.

Parágrafo único - Este Regulamento está adequado às normas estabelecidas para os RPPS.

Artigo 3º - A administração e a gestão da carteira do FUNDO são realizadas pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 00.360.305/0001-04, com sede na cidade de Brasília - DF, no Setor Bancário Sul, Quadra 04, Lotes 3/4, por meio da Vice-Presidência de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros, sita na Avenida Paulista nº 2.300, 11º andar, São Paulo - SP, CEP 01310-300, doravante designada, ADMINISTRADORA e/ou gestora.

Parágrafo único - A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL encontra-se devidamente qualificada, autorizada e registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários - CVM para prestação de Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM n.º 3.241, de 04 de janeiro de 1995.

Artigo 4º - Os serviços de custódia dos ativos financeiros do FUNDO são realizados pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL que está devidamente qualificado perante a CVM para prestação de serviços de custódia de Fundos de Investimento, conforme Ato Declaratório CVM n.º 6.661, de 10 de janeiro de 2002, doravante designada, CUSTODIANTE.

Artigo 5º - A relação completa dos prestadores de serviços pode ser consultada na página da ADMINISTRADORA na internet - www.caixa.gov.br.

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

Artigo 6º - Em razão de sua política de investimento, o FUNDO classifica-se como "Renda Fixa".

Artigo 7º - 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.

Parágrafo único - O prazo médio da carteira do FUNDO será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias.

Artigo 8º - 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 avaliam as tendências do mercado e as condições macroeconômicas e microeconômicas, respeitando-se os níveis e limites de risco definidos neste Regulamento.

Artigo 9º - Os ativos financeiros que compõem a carteira do FUNDO estarão expostos diretamente, ou através do uso de derivativos, ao risco das variações das taxas de juros prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços,

não havendo, necessariamente, um fator de risco principal.

Artigo 10 - As aplicações realizadas no FUNDO não contam com a garantia da ADMINISTRADORA ou do Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

Artigo 11 - A carteira do FUNDO será composta pelos ativos abaixo listados, respeitados os seguintes limites mínimos e máximos em relação ao patrimônio líquido (PL) do FUNDO:

Limites por Ativos		Mínimo	Máximo	Modalidade
GRUPO I	Títulos públicos federais	0%	100%	100%
	Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais			

Limites por Emissor	Mínimo	Máximo
União Federal	0%	100%

Utilização de Instrumentos Derivativos pelo FUNDO	Mínimo	Máximo
Para hedge e/ou posicionamento	0%	100%
Alavancagem	Vedado	

Outras operações do FUNDO	
Empréstimos de ativos financeiros de renda fixa - doador	Permitido
Empréstimos de ativos financeiros de renda fixa - tomador	Vedado

Operações com a ADMINISTRADORA, gestora ou empresas ligadas	
ADMINISTRADORA ou gestora como contraparte nas operações de FUNDO	Permitido

Parágrafo único - É vedado ao FUNDO aplicar:

I - os recursos em cotas de fundos de investimento, de qualquer modalidade; e

II - em ativos financeiros de renda variável e/ou adotar estratégias que gerem exposição em renda variável, direta ou indiretamente.

Artigo 12 - Os percentuais referidos no artigo anterior devem ser cumpridos diariamente, com base no patrimônio líquido do FUNDO com no máximo 1 (um) dia útil de defasagem.

FATORES DE RISCOS DO FUNDO

Artigo 13 - 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 seguintes riscos:

I - Risco de Mercado: uma vez que os ativos que compõem a carteira dos fundos são marcados a mercado, isto é, são avaliados diariamente de acordo com os preços em que houve negócios no dia, ou pela melhor estimativa, no caso de ativos pouco líquidos, o risco de mercado está relacionado à variação dos preços e cotações de mercado dos ativos que compõem a carteira do FUNDO. Nos casos em que houver queda no valor dos ativos nos quais o FUNDO investe, o patrimônio líquido do FUNDO pode ser afetado negativamente. As perdas podem ser temporárias, não existindo, contudo, garantias de que possam ser revertidas ao longo do tempo. Ativos de longo prazo podem sofrer mais com o risco de mercado.

II - Risco de Crédito: refere-se à possibilidade dos emissores dos ativos que fazem ou venham a fazer parte da carteira do FUNDO não cumprirem suas obrigações de pagamento do principal e dos respectivos juros de suas dívidas, por ocasião dos vencimentos finais e/ou antecipados. Adicionalmente, os contratos de derivativos estão eventualmente sujeitos ao inadimplemento da contraparte e à possibilidade da instituição garantidora não poder honrar sua liquidação.

III - Risco de Liquidez: consiste na possibilidade do FUNDO não possuir recursos necessários para o cumprimento de suas obrigações de pagamento de resgates de cotas, nos prazos legais e/ou no montante solicitado, em decorrência de condições atípicas de mercado, grande volume de solicitações de resgate e/ou possibilidade de redução ou mesmo inexistência de demanda pelos ativos componentes da carteira do FUNDO, por condições específicas atribuídas a tais ativos ou aos mercados em que são negociados. A falta de liquidez no mercado também pode ocasionar a alienação dos ativos por valor inferior ao efetivamente contabilizado. Essas dificuldades podem se estender por períodos longos e serem sentidas mesmo em situações de normalidade nos mercados. Os ativos de longo prazo podem sofrer mais com o risco de liquidez em decorrência do prazo de vencimento do ativo.

IV - Risco de Concentração: a eventual concentração dos investimentos do FUNDO em determinado(s) emissor(es), setor(es) ou prazo de vencimento do ativo, pode aumentar a sua exposição aos riscos anteriormente mencionados, ocasionando volatilidade no valor de suas cotas.

V - Risco Sistemático e de Regulação: motivos alheios ou exógenos, que afetam os investimentos financeiros como um todo e cujo risco não é eliminado através da diversificação, tais como moratória, fechamento parcial ou total dos mercados, em decorrência de quaisquer eventos, alterações na política monetária ou nos cenários econômicos nacionais e/ou internacionais, bem como a eventual interferência de órgãos reguladores do mercado, as mudanças nas regulamentações e/ou legislações, inclusive tributárias, aplicáveis a fundos de investimento, podem afetar o mercado financeiro resultando em alterações nas taxas de juros e câmbio, nos preços dos papéis e nos ativos em geral. Tais variações podem impactar os resultados das posições assumidas pelo FUNDO e, portanto, no valor das cotas e nas suas condições de operação.

VI - Risco Proveniente do uso de Derivativos: está relacionado à possibilidade dos instrumentos de derivativos não produzirem os efeitos esperados, bem como ocasionarem perdas ao Cotista, quando da realização ou vencimento das operações em decorrência da variação dos preços à vista dos ativos a eles relacionados, expectativas futuras de preços, liquidez dos mercados e do risco de crédito da contraparte. Mesmo que os instrumentos de derivativos possam ser utilizados para proteger as posições do FUNDO, esta proteção pode não ser perfeita ou suficiente para evitar perdas.

VII - Risco de Contraparte: está relacionado à possibilidade de uma ou mais partes de um negócio não cumprir suas obrigações contratuais, podendo assim, advir de uma contraparte com a qual não existe uma operação de financiamento ou empréstimo. Nos fundos de investimento, o risco de contraparte também pode estar relacionado ao risco de crédito

VIII - Risco operacional: consiste na possibilidade de perdas resultantes de falha, deficiência ou inadequação de processos internos, pessoas, sistemas ou de fatores exógenos diversos.

Parágrafo único - Mesmo que o FUNDO possua um fator de risco principal poderá sofrer perdas decorrentes de outros fatores.

MOVIMENTAÇÕES NO FUNDO

Artigo 14 - As cotas do FUNDO correspondem a frações ideais de seu patrimônio, são escriturais, nominativas e conferem iguais direitos e obrigações ao Cotista.

Artigo 15 - As movimentações de aplicação e resgate serão efetuadas em conta do aplicador, em moeda corrente nacional, observadas as seguintes condições:

Carência	Apuração da Cota	Periodicidade de Cálculo do Valor da Cota	Liquidação Financeira da Aplicação (em dias úteis)	Conversão de Cotas da Aplicação (em dias úteis)	Conversão de Cotas do Resgate (em dias úteis)	Liquidação Financeira do Resgate (em dias úteis)
Não há	No fechamento dos mercados em que o FUNDO atue	Diária	D+0 da solicitação	D+0 da solicitação	D+0 da solicitação	D+0 da solicitação

§ 1º - As solicitações de aplicação e/ou os pedidos de resgate deverão ser efetuados pelo Cotista dentro do horário estabelecido pela ADMINISTRADORA, conforme consta na página da ADMINISTRADORA na *internet* – www.caixa.gov.br.

§ 2º - A efetiva disponibilização do crédito ocorrerá em horário que não sejam permitidas as movimentações bancárias devido à necessidade de se aguardar o fechamento dos mercados em que o FUNDO atua para o cálculo do valor da cota.

§ 3º - A ADMINISTRADORA poderá suspender, a qualquer momento, novas aplicações no FUNDO, desde que tal suspensão se aplique indistintamente ao Cotista e a novos investidores.

Artigo 16 - Nos feriados na Cidade ou no Estado de São Paulo ou dias em que o mercado financeiro ou as bolsas de valores ou de mercadorias não estiverem em funcionamento, a ADMINISTRADORA não acatará pedidos de aplicação e de resgates no FUNDO, independente da praça em que o Cotista estiver localizado.

ENCARGOS E REMUNERAÇÃO

Artigo 17 - Constituem encargos do FUNDO, as seguintes despesas, que lhe podem ser debitadas diretamente:

I - taxas, impostos ou contribuições federais, estaduais, municipais ou autárquicas, que recaiam ou venham a recair sobre os bens, direitos e obrigações do FUNDO;

II - despesas com registro de documentos em cartório, impressão, expedição e publicação de relatórios e informações periódicas, previstas neste Regulamento ou na regulamentação pertinente;

III - despesas com correspondência de interesse do FUNDO, inclusive comunicações ao Cotista;

IV - honorários e despesas do auditor independente;

V - emolumentos e comissões pagas por operações do FUNDO;

VI - honorários de advogado, custas e despesas processuais correlatas, incorridas em razão de defesa dos interesses do FUNDO, em juízo ou fora dele, inclusive o valor da condenação imputada ao FUNDO, se for o caso;

VII - parcela de prejuízos não coberta por apólices de seguro e não decorrente diretamente de culpa ou dolo dos prestadores dos serviços de administração no exercício de suas respectivas funções;

VIII - despesas relacionadas, direta ou indiretamente, ao exercício de direito de voto decorrente de ativos financeiros do FUNDO;

IX - despesas com liquidação, registro e custódia de operações com títulos e valores mobiliários, ativos financeiros e modalidades operacionais;

X - despesas com fechamento de câmbio, vinculadas às suas operações ou com certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários;

XI - no caso de fundo fechado, a contribuição anual devida às bolsas de valores ou às entidades do mercado organizado em que o fundo tenha suas cotas admitidas à negociação;

XII - as taxas de administração e de performance, se houver;

XIII - os montantes devidos a fundos investidores na hipótese de acordo de remuneração com base na taxa de administração e/ou performance, observado ainda o disposto na legislação vigente; e

XIV - honorários e despesas relacionadas à atividade de formador de mercado.

Artigo 18 - Quaisquer despesas não previstas como encargos do FUNDO correrão por conta da ADMINISTRADORA.

Artigo 19 - A taxa de administração consiste no somatório das remunerações devidas pelo FUNDO à ADMINISTRADORA e a cada um dos prestadores dos seguintes serviços contratados pelo FUNDO, se houver: gestão da carteira, consultoria de investimento, tesouraria, controladoria, distribuição de cotas, escrituração de emissão e resgate de cotas e agência classificadora de risco.

Artigo 20 - A taxa de administração do FUNDO é de 0,20% (vinte centésimos por cento) ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO, vedada qualquer participação nos resultados distribuídos ou investidos pelo FUNDO.

Artigo 21 - A taxa de administração prevista no artigo anterior é calculada e provisionada a cada dia útil, à razão de 1/252 avos, com base no patrimônio líquido do FUNDO do dia útil imediatamente anterior e será paga semanalmente à ADMINISTRADORA.

Artigo 22 - Não serão cobradas taxas de ingresso e saída, nem taxa de performance do FUNDO.

Artigo 23 - A taxa máxima de custódia a ser paga pelo FUNDO ao CUSTODIANTE é de 0,005% (cinco milésimos por cento) ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO.

FORMA DE COMUNICAÇÃO E DIVULGAÇÃO DE INFORMAÇÕES

Artigo 24 - A ADMINISTRADORA utilizará canais eletrônicos, incluindo a rede mundial de computadores, como forma de comunicação e disponibilização de informações, extrato de conta, fatos relevantes e documentos, salvo as hipóteses previstas neste Regulamento.

§ 1º - Na hipótese de envio, pela ADMINISTRADORA, de correspondência física para o endereço de cadastro do Cotista, os custos decorrentes deste envio serão suportados pelo FUNDO.

§ 2º - Caso o Cotista não tenha comunicado à ADMINISTRADORA a atualização de seu endereço, seja para envio de correspondência por carta ou através de meio eletrônico, a ADMINISTRADORA ficará exonerada do dever de envio das informações previstas em regulamentação pertinente, a partir da última correspondência que tiver sido devolvida por incorreção no endereço declarado.

Artigo 25 - A ADMINISTRADORA disponibiliza ao Cotista do FUNDO: Central de Atendimento ao Cotista pelo número 0800-726-0101; Central de Atendimento a Pessoas com Deficiência Auditiva e de Fala pelo número 0800-726-2492; e serviço Ouvidoria CAIXA pelo número 0800-725-7474.

ASSEMBLEIA GERAL DE COTISTA

Artigo 26 - O Cotista será convocado para tratar de assuntos do FUNDO: (a) anualmente, até 120 (cento e vinte) dias após o encerramento do exercício social, para deliberação sobre as demonstrações contábeis ou (b) extraordinariamente, sempre que houver assuntos de interesse do FUNDO ou do Cotista.

Artigo 27 - A convocação da assembleia geral será enviada com antecedência mínima de 10 (dez) dias da data de sua realização e será disponibilizada na página da ADMINISTRADORA na *internet* - www.caixa.gov.br e do distribuidor, se for o caso.

Parágrafo único – Excepcionalmente, a critério da ADMINISTRADORA, a convocação da assembleia geral poderá ser enviada por meio de correspondência por carta, no prazo previsto no caput deste artigo.

Artigo 28 - O Cotista também poderá votar por meio de comunicação escrita ou eletrônica, desde que a manifestação de voto seja recebida pela ADMINISTRADORA até o dia útil anterior à data da realização da assembleia geral e tal possibilidade conste expressamente na convocação, com a indicação das formalidades a serem cumpridas.

Artigo 29 - A assembleia geral se instalará com a presença de qualquer número de Cotista, sendo que as deliberações serão tomadas por maioria de votos, cabendo a cada cota 1 (um) voto.

Parágrafo único - Na hipótese de instalação de assembleia extraordinária para deliberar a destituição da ADMINISTRADORA, a aprovação de tal matéria somente ocorrerá mediante quórum qualificado de metade mais uma das cotas emitidas pelo FUNDO.

Artigo 30 - A critério da ADMINISTRADORA, as deliberações da assembleia geral poderão ser adotadas mediante processo de consulta formal, sem necessidade de reunião de Cotista. O documento de consulta formal apresentará as informações e formalidades necessárias ao exercício de direito de voto e prazo para resposta.

Artigo 31 - O resumo das decisões da assembleia geral será disponibilizado na página da ADMINISTRADORA na *internet*, no prazo de até 30 (trinta) dias após a data de sua realização, podendo ser utilizado para tal finalidade o extrato mensal de conta.

EXERCÍCIO SOCIAL

Artigo 32 - O exercício social do FUNDO tem início em 1º de janeiro de cada ano e término em 31 de dezembro do mesmo ano, quando serão levantadas as demonstrações contábeis do FUNDO relativas ao período findo.

POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO DE RESULTADOS

Artigo 33 - Eventuais resultados relativos a ativos componentes da carteira do FUNDO serão incorporados ao seu respectivo patrimônio, quando do seu pagamento ou distribuição pelos emissores de tais ativos.

DISPOSIÇÕES GERAIS

Artigo 34 - Informações adicionais sobre o FUNDO podem ser consultadas na página da ADMINISTRADORA na *internet* – www.caixa.gov.br.



Artigo 35 - Fica eleito o foro da Justiça Federal da cidade de Brasília (DF), com expressa renúncia de qualquer outro, por mais privilegiado que possa ser, para quaisquer ações nos processos jurídicos relativos ao FUNDO ou a questões decorrentes deste Regulamento.

Assinam o presente instrumento os Procuradores da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

Brasília (DF), 19 de Agosto de 2019.

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Vice-Presidência Administração e Gestão de Ativos de Terceiros

Nota: Este Regulamento encontra-se averbado ao registro nº. 897.548, de 30/07/2009, no 2º Ofício de Registro de Títulos e Documentos da Cidade e Comarca de Brasília - DF.

(Regulamento aprovado através de Assembleia Geral Extraordinária realizada em 19/08/2019 e passando a vigorar em 17/10/2019).

Consulta Pública de Lâmina de Fundo

Atenção: Estas informações tem por base os documentos enviados à CVM pelas Instituições Administradoras dos Fundos de Investimento e são de exclusiva responsabilidade destas. Sua divulgação pela CVM não implica na garantia da veracidade das informações prestadas ou do julgamento sobre a qualidade do fundo.

Competência:	Dez/2020 ▼	Exibir	
Nome do Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		CNPJ: 11.060.913/0001-10
Tipo:	FDOS DE INVESTIMENTO		Cód. CVM: 143596
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		CNPJ: 00.360.305/0001-04

LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

Informações referentes a 12/2020

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO, administrado por CAIXA ECONOMICA FEDERAL e gerido por CAIXA ECONOMICA FEDERAL. As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Regulamento do fundo, disponíveis no www.caixa.gov.br. As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada.

Antes de investir, compare o fundo com outros da mesma classificação.

1. PÚBLICO-ALVO: O FUNDO destina-se a acolher investimentos de Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pelos Estados, Municípios e Distrito Federal do Brasil, das Entidades Públicas da Administração Direta, Autarquias, Fundações Públicas, Entidades Fechadas de Previdência Complementar, Fundos de Investimento e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento administrados pela ADMINISTRADORA, Entidades Abertas de Previdência Complementar, Companhias Seguradoras e Sociedades de Capitalização, previamente cadastrados perante ADMINISTRADORA.

Restrições de Investimento: .

2. OBJETIVOS DO FUNDO: Proporcionar rentabilidade compatível ao IMA-B 5, por meio da aplicação em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais.

3. POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:

a. Investir em carteira composta por títulos públicos e operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais, com prazo médio superior a 365 dias, estando exposto ao risco das variações das taxas prefixadas, pós fixadas e/ou índices de preços.

b. O fundo pode:

Aplicar em ativos no exterior até o limite de	0%
Aplicar em crédito privado até o limite de	0%
Aplicar em um só fundo até o limite de	0%
Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira?	N
Alavancar-se até o limite de	0%

- Item b com redação dada pela Instrução CVM nº 563, de 18 de maio de 2015.

c. A metodologia utilizada para o cálculo do limite de alavancagem, disposto no item 3.b é o percentual máximo que pode ser depositado pelo fundo em margem de garantia para garantir a liquidação das operações contratadas somado à margem potencial para a liquidação dos derivativos negociados no mercado de balcão.

d. As estratégias de investimento do fundo podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

4. CONDIÇÕES DE INVESTIMENTO

Investimento inicial mínimo	R\$ 1.000,00
Investimento adicional mínimo	R\$ 0,00
Resgate mínimo	R\$ 0,00
Horário para aplicação e resgate	16:00
Observação sobre horário para	

aplicação e resgate	
Valor mínimo para permanência	R\$ 0,00
Prazo de carência	Não há.
Condições de carência	Não há.
Conversão das cotas	Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do 0º dia contado da data da aplicação. No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do 0º dia contado da data do pedido de resgate.
Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é de 0 dia(s) útil(eis) contados da data do pedido de resgate.
Taxa de administração	0,2%
Taxa de entrada	Não há taxa fixada. Outras condições de entrada: Não há.
Taxa de saída	Para resgatar suas cotas do fundo o investidor paga uma taxa de 0% do valor do resgate, que é deduzida diretamente do valor a ser recebido. Outras condições de saída: Não há.
Taxa de desempenho/performance	Não há
Taxa total de despesas	As despesas pagas pelo fundo representaram 0,2% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/01/2020 a 31/12/2020 . A taxa de despesas pode variar de período para período e reduz a rentabilidade do fundo. O quadro com a descrição das despesas do fundo pode ser encontrado em www.caixa.gov.br .

5. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:[i]

O patrimônio líquido do fundo é de R\$ 20.761.505.098,56 e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são [ii] [iii]:

Títulos públicos federais	97,67%
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	2,32%
Derivativos	0%

6. RISCO: o Administrador CAIXA ECONOMICA FEDERAL classifica os fundos que administra numa escala de 1 a 5 de acordo com o risco envolvido na estratégia de investimento de cada um deles. Nessa escala, a classificação do fundo é: 3

Menor Risco				Maior Risco
1	2	3	4	5

7. HISTÓRICO DE RENTABILIDADE [iv] (para fundos não estruturados [v]) / SIMULAÇÃO DE DESEMPENHO (fundos estruturados [v])

- a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
- b. Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: 72,632%. No mesmo período o índice de referência [IMA-B 5] variou 74,613%.

A tabela abaixo mostra a rentabilidade do fundo a cada ano nos últimos 5 anos.

Tabela de Rentabilidade Anual

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do índice de referência [IMA-B 5]	Desempenho do fundo como % do índice de referência [IMA-B 5]
2016	15,19%	15,48%	98,12%
2017	12,38%	12,58%	98,44%
2018	9,67%	9,87%	97,99%
2019	12,86%	13,15%	97,72%
2020	7,75%	8,04%	96,37%

C. Rentabilidade Mensal : a rentabilidade do fundo nos últimos 12 meses foi: [vi]

Mês [vii]	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do índice de referência [IMA-B 5]	Desempenho do fundo como % do índice de referência [IMA-B 5]
1	0,54%	0,56%	97,78%
2	0,63%	0,64%	98,04%
3	-1,8%	-1,76%	102,41%
4	0,47%	0,49%	95,32%
5	2,11%	2,12%	99,29%
6	1,1%	1,12%	98,36%
7	0,97%	0,99%	98,38%
8	0,39%	0,43%	91,88%
9	-0,16%	-0,12%	129,01%
10	0,18%	0,2%	90,22%
11	1,29%	1,32%	97,58%
12	1,82%	1,83%	99,46%

a. **Fórmula de cálculo da rentabilidade completa, com todas as possíveis condições e cláusulas que afetarão o desempenho:** Não se aplica

b. **Exemplo do desempenho do fundo:** Os cenários e desempenhos descritos abaixo são meramente exemplificativos e servem somente para demonstrar como a fórmula de cálculo da rentabilidade funciona:

Variação do desempenho do Fundo	Fórmula de cálculo da rentabilidade	Valores dos cenários/gatilhos que afetam a rentabilidade	Esclarecimentos sobre como o cenário/gatilho afeta a variação de desempenho do fundo
0%	Não se aplica	Não se aplica	Não se aplica

8. **EXEMPLO COMPARATIVO:[viii]** utilize a informação do exemplo abaixo para comparar os custos e os benefícios de investir no fundo com os de investir em outros fundos.

a. **Rentabilidade:** Se você tivesse aplicado R\$ 1.000,00 (mil reais) no fundo no primeiro dia útil de 2019 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano, no primeiro dia útil de 2020 , você poderia resgatar R\$ 1.102,89, já deduzidos impostos no valor de R\$ 21,83.

- b. **Despesas:** As despesas do fundo, incluindo a taxa de administração, a taxa de performance e as despesas operacionais e de serviços teriam custado R\$ 2,25.

9. **SIMULAÇÃO DE DESPESAS:**[ix] utilize a informação a seguir para comparar o efeito das despesas em períodos mais longos de investimento entre diversos fundos:

Assumindo que a última taxa total de despesas divulgada se mantenha constante e que o fundo tenha rentabilidade bruta hipotética de 10% ao ano nos próximos 3 e 5 anos, o retorno após as despesas terem sido descontadas, considerando a mesma aplicação inicial de R\$ 1.000,00 (mil reais), é apresentado na tabela abaixo:

Simulação das Despesas	[+3 anos]	[+5 anos]
Saldo bruto acumulado (hipotético - rentabilidade bruta anual de 10%)	R\$ 1.331,00	R\$ 1.610,51
Despesas previstas (se a TAXA TOTAL DE DESPESAS se mantiver constante)	R\$ 6,62	R\$ 12,21
Retorno bruto hipotético após dedução das despesas e do valor do investimento original (antes da incidência de impostos, de taxas de ingresso e/ou saída, ou de taxa de performance)	R\$ 324,38	R\$ 598,30

Este exemplo tem a finalidade de facilitar a comparação do efeito das despesas no longo prazo. Esta simulação pode ser encontrada na lâmina e na demonstração de desempenho de outros fundos de investimento.

A simulação acima não implica promessa de que os valores reais ou esperados das despesas ou dos retornos serão iguais aos aqui apresentados.

10. POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO:

- a. **Descrição da forma de remuneração dos distribuidores:**

O serviço de distribuição de cotas de fundos de investimento é remunerado exclusivamente pela taxa de administração, não havendo qualquer cobrança adicional ou repasse para terceiros. As cotas do FUNDO são distribuídas exclusivamente pela ADMINISTRADORA através da sua rede de agências e canais eletrônicos.

- b. O principal distribuidor oferta, para o público alvo do fundo, preponderantemente fundos geridos por um único gestor, ou por gestores ligados a um mesmo grupo econômico?

O distribuidor oferta ao cotista e potenciais investidores preponderantemente fundos de investimento por ela geridos.

c. Há informações que indiquem a existência de conflitos de interesses no esforço de venda?

Não se aplica

11. SERVIÇO DE ATENDIMENTO AO COTISTA:

a. Telefone 08007260101

b. Página na rede mundial de computadores www.caixa.gov.br

c. Reclamações: www.caixa.gov.br/ Ouvidoria Caixa: 08007257474

12. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO:

a. Comissão de Valores Mobiliários - CVM

b. Serviço de Atendimento ao Cidadão em <http://www.cvm.gov.br>.

[i] Item dispensado nas lâminas apresentadas para registro do fundo, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[ii] Quando se tratar de fundo de investimento em cotas ☐ FIC, a informação deve ser dada em relação à carteira dos fundos investidos.

[iii] Para efeito de preenchimento, as espécies de ativos são: Espécie de ativo	Descrição
Títulos públicos federais	LTN; LFT; todas as séries de NTN
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	Operações de compra ou venda de ativos pelo fundo com garantia de recompra ou revenda pelo vendedor

Operações compromissadas lastreadas em títulos privados	Operações de compra ou venda de ativos pelo fundo com garantia de recompra ou revenda pelo vendedor
Ações	Ações e certificados de depósito de ações de companhias abertas
Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	CDB, RDB, LF, DPGE, CCCB, LCA, LCI
Cotas de fundos de investimento 409	Cotas de fundos de investimento regulados pela Inst. CVM nº 409, de 2004
Outras cotas de fundos de investimento	Cotas de fundos de investimento regulados por outras instruções da CVM.
Títulos de crédito privado	Debêntures, notas promissórias, commercial paper , export note , CCB, CPR, WA, NCA, CDA e CDCA
Derivativos	Swaps , opções, operações a termo e operações no mercado futuro
Investimento no exterior	Ativos financeiros adquiridos no exterior
Outras aplicações	Qualquer aplicação que não possa ser classificada nas opções anteriores

[iv] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[v] Os fundos estruturados são definidos no OFÍCIO-CIRCULAR/CVM/SIN/Nº01/2010, de 8 de janeiro de 2010.

[vi] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[vii] Meses devem ser ajustados de acordo com a data de atualização da lâmina.

[viii] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[ix] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

Consulta de Formulário de Informações Complementares

Atenção: Estas informações tem por base os documentos enviados à CVM pelas Instituições Administradoras dos Fundos de Investimento e são de exclusiva responsabilidade destas. Sua divulgação pela CVM não implica na garantia da veracidade das informações prestadas ou do julgamento sobre a qualidade do fundo.

Competência	14/09/2018 ▾	Exibir
Nome do Fundo	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	
CNPJ do Fundo	11.060.913/0001-10	
Tipo do Fundo	FDOS DE INVESTIMENTO	
Cód. CVM	143596	
Administrador	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	
CNPJ do Administrador	00.360.305/0001-04	

Formulário de Informações Complementares

Informações Complementares de código:

35161

CNPJ do fundo:

11.060.913/0001-10

Periodicidade mínima para divulgação da composição da carteira do fundo:

Mensalmente, até o dia 10 do mês subsequente ao de referência, por tipo de ativo e emissor, podendo haver defasagem em tal divulgação, nos termos da legislação vigente.

Local, Meio ou forma de divulgação

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

O valor da cota e do patrimônio líquido do FUNDO serão disponibilizados por meios eletrônicos e/ou na página da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) - www.cvm.gov.br

Descrição da forma de Divulgação:

Diariamente

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

O balancete, a composição da carteira, o perfil mensal e a lâmina de informações essenciais (se houver) do FUNDO serão disponibilizados por meios eletrônicos e/ou na página da Comissão de Valores Mobiliários - www.cvm.gov.br

Descrição da forma de Divulgação:

Mensalmente, até o dia 10 do mês subsequente ao de referência

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

As demonstrações de desempenho do FUNDO relativas aos 12 meses findos em 31 de dezembro e aos 12 meses findos em 30 de junho, serão disponibilizadas na página da ADMINISTRADORA na internet - www.caixa.gov.br

Descrição da forma de Divulgação:

Anualmente, até o último dia útil dos meses de fevereiro e de agosto de cada ano

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

O formulário de informações complementares do FUNDO será disponibilizado na página da ADMINISTRADORA na internet - www.caixa.gov.br e na página da Comissão de Valores Mobiliários- www.cvm.gov.br

Descrição da forma de Divulgação:

Sempre que houver alteração do seu conteúdo

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

As demonstrações contábeis do FUNDO serão disponibilizadas na página da ADMINISTRADORA na internet - www.caixa.gov.br e na página da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) - www.cvm.gov.br

Descrição da forma de Divulgação:

Anualmente, em até 90 dias após o encerramento do exercício social

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

Qualquer ato ou fato relevante ocorrido ou relacionado ao funcionamento do FUNDO ou aos ativos financeiros integrantes de sua carteira, será disponibilizado na página da ADMINISTRADORA na internet - www.caixa.gov.br e na página da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) - www.cvm.gov.br

Descrição da forma de Divulgação:

Sempre que houver qualquer ato ou fato relevante

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

O extrato mensal de conta, contendo as informações previstas na legislação vigente, será disponibilizado por canais eletrônicos da ADMINISTRADORA

Descrição da forma de Divulgação:

Mensalmente

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

A convocação de assembleia geral de cotistas do FUNDO será realizada por meios eletrônicos, conforme Regulamento, e disponibilizada na página da ADMINISTRADORA na internet - www.caixa.gov.br. O resumo das deliberações será disponibilizado por meios eletrônicos

Descrição da forma de Divulgação:

Anualmente, no caso de assembleia ordinária, e eventualmente, no caso de assembleia extraordinária

Local, Meio ou forma de divulgação cotista

Tipo do meio de divulgação: Físico

Descrição de texto enviada pela instituição:

Informações adicionais sobre o FUNDO podem ser solicitadas à ADMINISTRADORA e serão disponibilizadas, a seu exclusivo critério, desde que de forma equânime aos cotistas e demais interessados.

Descrição do local de divulgação

Diretamente nas Agências ou na sede da ADMINISTRADORA

Descrição da forma de divulgação

A qualquer tempo

Tipo do meio de divulgação: Eletrônico

Descrição de texto enviada pela instituição:

Informações adicionais sobre o FUNDO podem ser solicitadas à ADMINISTRADORA e serão disponibilizadas, a seu exclusivo critério, desde que de forma equânime aos cotistas e demais interessados.

Descrição do local de divulgação

Na página da ADMINISTRADORA na internet - www.caixa.gov.br

Descrição da forma de divulgação

A qualquer tempo

Tipo do meio de divulgação: Eletrônico

Descrição de texto enviada pela instituição:

Informações adicionais sobre o FUNDO podem ser solicitadas à ADMINISTRADORA e serão disponibilizadas, a seu exclusivo critério, desde que de forma equânime aos cotistas e demais interessados.

Descrição do local de divulgação

Central de Atendimento ao Cotista: 0800-726-0101;

Descrição da forma de divulgação

A qualquer tempo

Tipo do meio de divulgação: Eletrônico

Descrição de texto enviada pela instituição:

Informações adicionais sobre o FUNDO podem ser solicitadas à ADMINISTRADORA e serão disponibilizadas, a seu exclusivo critério, desde que de forma equânime aos cotistas e demais interessados.

Descrição do local de divulgação

Ouvidoria: 0800-725-7474; Atendimento a Pessoas com Deficiência Auditiva e de Fala: 0800-726-2492

Descrição da forma de divulgação

A qualquer tempo

Exposição, em ordem de relevância, dos fatores de riscos inerentes à composição da carteira 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. Risco proveniente do uso de derivativos: possibilidade dos instrumentos de derivativos não produzirem os efeitos esperados, bem como, ocasionarem perdas aos cotistas quando da realização ou vencimento das operações. Risco de liquidez: dificuldade em honrar com os pagamentos de resgates solicitados, nos prazos legais e/ou no montante solicitado, além da possibilidade de venda de ativos com pouca demanda a preço abaixo do contabilizado. Risco de concentração: eventual concentração dos investimentos em determinados emissores, setores ou prazo de vencimento do ativo, pode aumentar a exposição aos riscos já mencionados, ocasionando volatilidade no valor de suas cotas. Risco sistêmico e de regulação: motivos exógenos, que afetam os investimentos financeiros como um todo e cujo risco não é eliminado através de diversificação, e mudanças nas regulamentações e/ou legislação. Risco de crédito: inadimplemento de principal ou juros por parte de empresa emissora de títulos de dívida em que o FUNDO invista. Eventualmente os contratos de derivativos poderão estar sujeitos ao inadimplemento da contraparte e à possibilidade da instituição garantidora não poder honrar sua liquidação. Risco operacional: Consiste na possibilidade de perdas resultantes de falha, deficiência ou inadequação de processos internos, pessoas, sistemas ou de fatores exógenos diversos. Risco de contraparte: Relacionado à possibilidade de uma ou mais partes de um negócio não cumprir suas obrigações contratuais, podendo assim, advir de uma contraparte com a qual não existe uma operação de financiamento ou empréstimo. Nos fundos de investimento, o risco de contraparte também pode estar relacionado ao risco de crédito.

Informações Políticas sobre o gestor

Informar se o gestor vota ou não em assembleias dos ativos que compõem a carteira: Não

Descrição da política relativa ao exercício de direito do voto:

A gestora deste FUNDO não exerce política de exercício do direito de voto em assembleias gerais convocadas para deliberar sobre ativos financeiros dos quais o FUNDO seja titular.

Descrição da tributação aplicável ao fundo e a seus cotistas, contemplando a política a ser adotada pelo administrador quanto ao tratamento tributário perseguido

As operações da carteira do FUNDO não estão sujeitas ao Imposto de Renda (IR) e sujeitam-se a alíquota zero de IOF-Títulos e Valores Mobiliários, salvo aquelas realizadas nos termos do Decreto nº 6.306/2007 e alterações posteriores, que poderão estar sujeitas a incidência de IOF. Alterações na legislação fiscal vigente acarretarão modificações nos procedimentos tributários aplicáveis ao Fundo e aos cotistas. O cotista está sujeito a seguinte tributação: A) Incidirá imposto de renda na fonte sobre os rendimentos auferidos no FUNDO, por ocasião do resgate, em função do prazo de permanência, às seguintes alíquotas de longo prazo: I - 22,5% em aplicações com prazo de até 180 dias de permanência; II - 20% em aplicações com prazo de 181 dias até 360 dias de permanência; III - 17,5% em aplicações com prazo de 361 dias até 720 dias de permanência; IV - 15% em aplicações com prazo acima de 720 dias de permanência. B) Semestralmente, no último dia útil dos meses de maio e novembro, incidirá imposto de renda na fonte sobre os rendimentos auferidos no FUNDO à alíquota de 15%. C) Por ocasião do resgate das cotas será aplicada alíquota complementar de acordo com o previsto nos incisos I a III do item A. D) Incidirá IOF - Títulos e Valores Mobiliários à alíquota de 1% ao dia, limitado aos rendimentos auferidos, de acordo com tabela decrescente em função do prazo, disponível no site www.caixa.gov.br. E) O disposto acima não se aplica aos cotistas que não estão sujeitos à tributação, conforme legislação tributária e fiscal vigente, desde que apresentada documentação comprobatória, se for o caso.

Descrição da política de administração de risco, em especial dos métodos utilizados pelo administrador para gerenciar os riscos a que o fundo se encontra sujeito, inclusive risco de liquidez

A ADMINISTRADORA possui uma área de risco responsável pelo controle, monitoramento e gerenciamento dos riscos a que estão expostos os fundos de investimento. Para o gerenciamento do risco de mercado é utilizado modelo estatístico VaR (Value at Risk), que mensura a perda máxima esperada, dado um nível de confiança e um período de análise, em condições normais de mercado e a Análise de Stress que é utilizada para estimar a perda potencial, sob as condições mais adversas de mercado ocorridas em determinado período, ou sob cenários de stress. O controle do risco de crédito é realizado por meio de uma política de crédito e um processo de análise dos emissores dos ativos financeiros atendendo à política de investimento do FUNDO. Para atendimento aos resgates e outras exigibilidades, o gerenciamento de liquidez no FUNDO utiliza modelo que contempla projeção de fluxo de caixa, histórico de aplicações e resgate, classificação de liquidez dos ativos baseada no histórico de negociação no mercado secundário e acompanhamento de concentração por vencimentos, por prazo e por cotistas. OS MÉTODOS UTILIZADOS PELA ADMINISTRADORA PARA GERENCIAR OS RISCOS A QUE O FUNDO SE ENCONTRA SUJEITO NÃO CONSTITUEM GARANTIA CONTRA EVENTUAIS PERDAS PATRIMONIAIS QUE POSSAM SER INCORRIDAS PELO FUNDO.

Informações de Risco

Informação se existe ou não agência de classificação de rating

Não

CNPJ**Nome do Prestador**

N/A

Classificação obtida pela agência de classificação de risco de crédito contratada

N/A

Padronização do disclaimer relativo a advertência da manutenção do serviço pela CVM

N/A

Detalhamento do administrador**Apresentação do administrador**

A Caixa Econômica Federal (CAIXA), instituição financeira sob a forma de empresa pública, por meio de sua Vice-Presidência Administração e Gestão de Ativos de Terceiros (VIART), encontra-se devidamente registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários (CVM) e autorizada para a prestação dos serviços de administração de carteira de valores mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº. 3.241, de 04 de janeiro de 1995. A atividade de administração e gestão de recursos de terceiros iniciou-se na CAIXA em 1991 e, desde 1998, a VIART atua de maneira segregada das atividades que envolvam recursos próprios da Instituição, garantindo transparência, independência, exclusividade de atuação e conduta ética na gestão de recursos de terceiros. Buscando sempre se adequar às melhores práticas de mercado, a VIART possui estrutura técnica qualificada, formada pelas áreas de: administração, produto, estratégia e inteligência de mercado, gestão de ativos, estudos econômicos e análise setorial, pesquisa quantitativa, fundos estruturados e gerenciamento de risco. A VIART possui, ainda, área de compliance, responsável por acompanhar a conformidade técnica das operações de gestão e conta com suporte jurídico da CAIXA na prestação de assessoria especializada. Como parte do aprimoramento das técnicas de gestão, utiliza-se de consultorias internas e externas. A CAIXA é aderente ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para: - Ética; - Negociação de Instrumentos Financeiros; - Distribuição de Produtos de Investimento no Varejo - Processos da Regulação e

Melhores Práticas; - Fundos de Investimento; - Programa de Certificação Continuada; - Ofertas Públicas de Distribuição e Aquisição de Valores Mobiliários; e - Serviços Qualificados ao Mercado de Capitais;

Apresentação do gestor de recursos

A CAIXA também é responsável pela gestão do FUNDO.

Detalhamento do Serviço Prestado

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Administração

Nome do Prestador:

Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Gestão da Carteira

Nome do Prestador:

Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Distribuição de Cotas

Nome do Prestador:

Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Custódia, tesouraria, controle e processamento dos ativos financeiros

Nome do Prestador:

Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Escrituração de Cotas

Nome do Prestador:

Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Auditoria Independente

Nome do Prestador:

KPMG Auditores Independentes - CNPJ: 57.755.217/0001-29

Detalhamento de Distribuição

Indicação se o distribuidor oferta para o público alvo do fundo, preponderantemente, fundos geridos por um único gestor ou por gestoras ligadas a um mesmo grupo econômico: Sim

Descrição detalhada

As cotas do FUNDO são distribuídas exclusivamente pela CAIXA, que oferta ao cotista e potenciais investidores preponderantemente fundos de investimento por ela geridos. O serviço de distribuição de cotas de fundos de investimento é remunerado somente pela taxa de administração, não havendo qualquer cobrança adicional ou repasse para terceiros.

Outras Informações

Informações sobre autorregulação anbima:

ESTE FORMULÁRIO ESTÁ EM CONSONÂNCIA COM AS DISPOSIÇÕES DO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA A ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS DE TERCEIROS, ASSIM COMO COM AS NORMAS EMANADAS PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS. A COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS E A ANBIMA NÃO GARANTEM A VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESTE FORMULÁRIO. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTES FUNDOS NÃO IMPLICA, POR PARTE DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS OU DA ANBIMA, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS, OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO FUNDO, DE SEU ADMINISTRADOR OU DAS DEMAIS INSTITUIÇÕES PRESTADORAS DE SERVIÇOS. O INVESTIMENTO DO FUNDO DE QUE

TRATA ESTE FORMULÁRIO APRESENTA RISCOS PARA O INVESTIDOR. AINDA QUE O GESTOR DA CARTEIRA MANTENHA SISTEMA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS, NÃO HÁ GARANTIA DE COMPLETA ELIMINAÇÃO DA POSSIBILIDADE DE PERDAS PARA O FUNDO E PARA O INVESTIDOR. O INVESTIMENTO EM FUNDO NÃO É GARANTIDO PELO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO. RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RESULTADOS FUTUROS. AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE FORMULÁRIO ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO, MAS NÃO O SUBSTITUEM. É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA TANTO DESTE FORMULÁRIO, QUANTO DO REGULAMENTO, COM ESPECIAL ATENÇÃO PARA AS CLÁUSULAS RELATIVAS AO OBJETIVO E À POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO, BEM COMO ÀS DISPOSIÇÕES DO FORMULÁRIO E DO REGULAMENTO QUE TRATAM DOS FATORES DE RISCO A QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO. A PRESENTE INSTITUIÇÃO ADERIU AO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO. ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS.

Demais informações relevantes ao investidor

Tipo ANBIMA: RENDA FIXA INDEXADOS - Fundos que têm como objetivo acompanhar as variações de indicadores de referência do mercado de Renda Fixa, não admitindo alavancagem. Parâmetros de Movimentações: Investimento inicial mínimo: R\$ 1.000,00; Investimento Adicional mínimo: R\$ 0,00; Resgate mínimo: R\$ 0,00; Valor mínimo de permanência: R\$ 0,00; Horário para aplicação e resgate: 16:00 (i) A integralização do valor das cotas deve ser realizada em moeda corrente nacional, sendo o valor da cota o resultado, da divisão do valor do patrimônio líquido do FUNDO pelo número de cotas existentes, inteiras e fracionárias. A qualidade de cotista caracteriza-se pela inscrição do nome do titular no registro de cotistas do FUNDO. (ii) Não se admite a cessão ou transferência de cotas do FUNDO, salvo por decisão judicial ou arbitral, operações de cessão fiduciária, execução de garantia, sucessão universal, dissolução de sociedade conjugal ou união estável por via judicial ou escritura pública que disponha sobre a partilha de bens e transferência de administração ou portabilidade de planos de previdência. (iii) Somente poderá votar na Assembleia Geral o cotista do FUNDO inscrito no registro de cotistas na data da convocação da Assembleia, seus representantes legais ou procuradores legalmente constituídos há menos de 1 (um) ano. Os representantes legais e os procuradores dos cotistas deverão comprovar essa qualidade por ocasião da Assembleia Geral. (iv) Os investimentos dos cotistas, por sua própria natureza e em função da política de investimento do FUNDO, estarão sempre sujeitos à perda do capital investido, em decorrência de, mas não se limitando a flutuações de mercado, risco de crédito e risco de liquidez, não podendo a ADMINISTRADORA, em hipótese alguma, ser responsabilizada por eventual depreciação dos ativos financeiros da carteira, salvo em caso de dolo ou má-fé. (v) A ADMINISTRADORA é obrigada a adotar as normas de conduta previstas na legislação vigente.

Consulta de Perfil Mensal

CNPJ: 11.060.913/0001-10
Nome: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO
Mês de Referência: 12/2020 ▼

1. Número de clientes do Fundo no último dia útil do mês de referência, por tipo de cliente:

a) Pessoa física <i>private banking</i>	0
b) Pessoa física varejo	0
c) Pessoa jurídica não-financeira <i>private banking</i>	0
d) Pessoa jurídica não-financeira varejo	0
e) Banco comercial	0
f) Corretora ou distribuidora	0
g) Outras pessoas jurídicas financeiras	0
h) Investidores não residentes	0
i) Entidade aberta de previdência complementar	0
j) Entidade fechada de previdência complementar	0
l) Regime próprio de previdência dos servidores públicos	946
m) Sociedade seguradora ou resseguradora	0
n) Sociedade de capitalização e de arrendamento mercantil	0
o) Fundos e clubes de Investimento	3
p) Cotistas de distribuidores do fundo (distribuição por conta e ordem)	0
q) Outros tipos de cotistas não relacionados	27

2. Distribuição percentual do patrimônio do Fundo no último dia útil do mês de referência, por tipo de cliente cotista:

a) Pessoa física <i>private banking</i>	0%
b) Pessoa física varejo	0%
c) Pessoa jurídica não-financeira <i>private banking</i>	0%
d) Pessoa jurídica não-financeira varejo	0%
e) Banco comercial	0%
f) Corretora ou distribuidora	0%
g) Outras pessoas jurídicas financeiras	0%
h) Investidores não residentes	0%
i) Entidade aberta de previdência complementar	0%
j) Entidade fechada de previdência complementar	0%

l) Regime próprio de previdência dos servidores públicos;	48,8%
m) Sociedade seguradora ou resseguradora	0%
n) Sociedade de capitalização e de arrendamento mercantil	0%
p) Fundos e clubes de Investimento	50,1%
p) Cotistas de distribuidores do fundo (distribuição por conta e ordem)	0%
q) Outros tipos de cotistas não relacionados	1,1%

3. Resumo do teor dos votos proferidos pelo administrador, gestor ou por seus representantes, nas assembleias gerais e especiais das companhias nas quais o fundo detenha participação, que tenham sido realizadas no período.

Não Informado

4. Justificativa sumária do voto proferido pelo administrador, gestor ou por seus representantes, ou as razões sumárias para a sua abstenção ou não comparecimento à assembleia geral.

Não Informado

7. Prazo médio da carteira de títulos do fundo (em meses (30 dias) e calculado de acordo com a metodologia regulamentada pela RFB) no último dia útil do mês de referência No último dia útil do mês de referência, qual o prazo médio da carteira de títulos do fundo? (em meses (30 dias) e calculado de acordo com a metodologia regulamentada pela SRF) No último dia útil do mês de referência, qual o prazo médio da carteira de títulos do fundo? (em meses (30 dias) e calculado de acordo com a metodologia regulamentada pela RFB

26,8333

8. Deliberações aprovadas na assembleia geral de cotistas do fundo no mês de referência.

Não Informado

9. Total de recursos (em US\$) enviados para o exterior para aquisição de ativos - Valor total dos contratos de compra de US\$ liquidados no mês.

0,00

10. Total de recursos (em US\$) ingressados no Brasil referente a venda de ativos - Total de contratos de venda de US\$ liquidados no mês.

0,00

17. Qual o valor nocional total de todos os contratos derivativos negociados em balcão mantidos pelo fundo, em % do patrimônio líquido, conforme tabela (informar valor numérico inteiro, contemplando a soma dos nocionais em módulo)..

Fator de Risco	Long	Short
Ibovespa	Não Informado	Não Informado
Juros-Pré	Não Informado	Não Informado
Cupom Cambial	Não Informado	Não Informado
Dólar	Não Informado	Não Informado
Outros	Não Informado	Não Informado

19. Total dos ativos (em % do PL) em estoque de emissão de partes relacionadas. O termo parte relacionada é aquele do artigo 86, § 1º, incs. II e III, da Instrução CVM nº 409, de 2004.

0,00

20. Relacionar os 3 maiores emissores de títulos de crédito privado que o fundo é credor, informando o CNPJ/CPF do emissor, se é parte relacionada ao administrador ou gestor do fundo, e o valor total aplicado pelo fundo, em % do seu patrimônio líquido. Considerar como de um mesmo emissor os ativos emitidos por partes relacionadas de um mesmo grupo econômico (informar CNPJ/CPF do emissor mais representativo). O termo parte relacionada é aquele do artigo 86, § 1º, incs. II e III, da Instrução CVM nº 409, de 2004.

Comitente (CPF/CNPJ):	Parte relacionada (S/N)	% PL numérico com uma casa decimal
Não Informado	Não Informado	0,00
Não Informado	Não Informado	Não Informado
Não Informado	Não Informado	Não Informado

21. **Total dos ativos de crédito privado (em % do PL) em estoque.**

0,00

22. **Caso o fundo cobre taxa de performance, informar se é vedada no regulamento a cobrança de taxa de performance quando o valor da cota do fundo for inferior ao seu valor por ocasião da última cobrança efetuada, na forma do disposto no § 2º do art. 62 da Instrução CVM nº 409, de 2004.**

Não Informado

23. **No caso de a resposta a pergunta anterior ser afirmativa, informar a data e o valor da cota do fundo quando da última cobrança de performance efetuada.**

Data	Valor
Não Informado	Não Informado

24. **Caso a carteira do fundo tenha originado direitos a dividendos, juros sobre capital próprio ou outros rendimentos advindos de ativos financeiros que compõem a carteira e, no período, tenha ocorrido distribuição de tais direitos diretamente aos clientes, informar o montante distribuído (R\$).**

0,00

25. **Informações complementares sobre o perfil mensal.**

Não Informado

DEMONSTRAÇÃO DE DESEMPENHO DO CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

11.060.913/0001-10

Informações referentes a Dezembro de 2020

1. Denominação completa do fundo conforme o cadastro na CVM: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO

RENTABILIDADE

2. Rentabilidade

2.1 Mensal: a rentabilidade do fundo nos últimos 12 meses foi:

Mês	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do IMA-B 5	Contribuição em relação ao índice de referência (Contribuição em relação ao índice de referência (Rentabilidade do fundo – Rentabilidade do índice)
jan/20	0,544%	0,556%	97,782%
fev/20	0,630%	0,642%	98,044%
mar/20	-1,797%	-1,755%	102,411%
abr/20	0,465%	0,488%	95,315%
mai/20	2,105%	2,120%	99,286%
jun/20	1,099%	1,117%	98,361%
jul/20	0,974%	0,990%	98,377%
ago/20	0,392%	0,426%	91,882%
set/20	-0,159%	-0,123%	129,009%
out/20	0,181%	0,201%	90,222%
nov/20	1,288%	1,320%	97,575%
dez/20	1,820%	1,830%	99,462%
12 meses	7,747%	8,039%	96,368%

2.2 Últimos 5 (cinco) anos:

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do IMA-B 5	Contribuição em relação ao índice de referência (Contribuição em relação ao índice de referência (Rentabilidade do fundo – Rentabilidade do índice)
2020	7,747%	8,039%	96,368%
2019	12,855%	13,154%	97,724%
2018	9,668%	9,865%	97,994%
2017	12,382%	12,578%	98,441%
2016	15,191%	15,482%	98,124%

DESPESAS

3. Despesas do fundo: as despesas apresentadas na tabela abaixo são debitadas diretamente do patrimônio do fundo e reduzem a sua rentabilidade. A taxa de despesas é baseada nas despesas ocorridas entre **Dez/2019 e Dez/2020**. A taxa de Despesas pode variar de período para período.

Despesas do Fundo		Percentual em relação ao patrimônio líquido diário médio em Dez/2020
Taxa de Administração (inclui as taxas de administração e de performance, se houver, de outros fundos em que este fundo tenha investido)	Parte Fixa	0,200%
	Parte Variável (taxa de performance)	0,000%
Taxa de Custódia		0,000%
Outras Despesas (inclui despesas de serviços de auditoria, etc.)		0,000%
TAXA TOTAL DE DESPESAS		0,210%
Despesas do fundo pagas ao grupo econômico do administrador (e do gestor, se este for diferente)		Percentual em relação à taxa de despesas em Dez/2020
Despesas pagas ao grupo econômico do administrador	Taxa de Administração	97,620%
	Despesas Operacionais e de serviços	0,000%
Despesas pagas ao grupo econômico do gestor	Taxa de Administração	0,000%
	Despesas Operacionais e de serviços	0,000%
TOTAL		97,620%

EXEMPLO COMPARATIVO

4. Exemplo Comparativo: utilize a informação do exemplo abaixo para comparar os custos e os benefícios de investir nesse fundo com os de investir em outros fundos.

Rentabilidade: Se você tivesse aplicado R\$ 1.000,00 (mil reais) no fundo no primeiro dia útil de 2019 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano, no primeiro dia útil de 2020, você poderia resgatar R\$ 1.102,89, já deduzidos impostos no valor de R\$ 21,83.

Despesas: As despesas do fundo, incluindo a taxa de administração, a taxa de performance (se houver), e as despesas operacionais e de serviços teriam custado R\$ 2,25.

SIMULAÇÃO DE DESPESAS

5. Simulação de Despesas: utilize a informação a seguir para comparar o efeito das despesas em períodos mais longos de investimento entre diversos fundos:

Assumindo que a última taxa total de despesas divulgada se mantenha constante e que o fundo tenha rentabilidade bruta hipotética de 10% no ano nos próximos 3 e 5 anos, o retorno após as despesas terem sido descontadas, considerando a mesma aplicação inicial de R\$ 1.000,00 (mil reais), é apresentado na tabela abaixo:

Simulação de Despesas	Dez/2020 + 3 anos	Dez/2020 + 5 anos
Saldo bruto acumulado (hipotético - rentabilidade bruta anual de 10%)	R\$ 1.331,10	R\$ 1.610,51
Despesas previstas (se a TAXA TOTAL DE DESPESAS se mantiver constante)	R\$ 6,95	R\$ 12,82
Retorno bruto hipotético após dedução de despesas (antes da incidência de impostos, de taxas de ingresso e/ou saída, ou de taxa de performance)	R\$ 324,05	R\$ 597,69

A simulação acima não implica promessa de que os valores reais ou esperados das despesas ou dos retornos serão iguais aos aqui apresentados.

ESCLARECIMENTOS

6. Esclarecimentos:

Exemplo comparativo e investimento de longo prazo: o exemplo comparativo (item 4) e o quadro de simulação de despesas (item 5) apresentados acima servem para facilitar a comparação do desempenho de seu fundo com o de outros fundos de investimento. É possível encontrar os mesmos exemplos, calculados a partir das mesmas hipóteses, nas lâminas (nos respectivos itens 8 e 9) de outros fundos de investimento. As lâminas estão disponíveis nas páginas eletrônicas dos administradores dos fundos na rede mundial de computadores.

Despesas de fundos investidos: as despesas apresentadas foram acrescidas das despesas de outros fundos em que este fundo tenha feito aplicações, proporcionalmente ao valor e período do investimento.

Rentabilidade: a rentabilidade do fundo não considera despesas individuais, pagas diretamente por cada cotistas, como o imposto de renda, o ajuste sobre performance individual, quando permitido pelo regulamento do fundo, e taxas de ingresso e/ou de saída, quando permitidas pelo regulamento. Todos esses valores reduzem a rentabilidade da aplicação do cotista, que será inferior à rentabilidade do fundo. Ao comparar fundos de investimento, verifique o tratamento tributário do fundo e a existência de taxas de ingresso, de saída, ou de performance e seu possível impacto no retorno da aplicação.

Impostos:

Imposto de Renda (sobre o ganho nominal): de acordo com as hipóteses do exemplo comparativo, existe somente um resgate total após um ano. Dessa forma, a alíquota incidente sobre os rendimentos para a aplicação pelo período de 1 anos teria sido de 17,5%. Exceção: No caso do fundo de renda fixa de curto prazo, a alíquota teria sido de 20%.

ATENDIMENTO AO COTISTA

SAC CAIXA: 0800 726 0101 (informações, reclamações, sugestões e elogios)

Para pessoas com deficiência auditiva: 0800 726 2492

Ouvidoria: 0800 725 7474 (reclamações não solucionadas e denúncias)

www.caixa.gov.br

Fundo de
Investimento Caixa
Brasil IMA-B 5
Títulos Públicos
Renda Fixa Longo
Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10
(Administrado pela Caixa Econômica Federal)
(CNPJ: 00.360.305/0001-04)

**Demonstrações financeiras em
31 de dezembro de 2019**

Conteúdo

Relatório dos auditores independentes sobre as demonstrações financeiras	3
Demonstrativo da composição e diversificação da carteira	7
Demonstrações das evoluções do patrimônio líquido	8
Notas explicativas às demonstrações financeiras	9
Anexo - Demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio	18



KPMG Auditores Independentes
Rua Arquiteto Olavo Redig de Campos, 105, 6º andar - Torre A
04711-904 - São Paulo/SP - Brasil
Caixa Postal 79518 - CEP 04707-970 - São Paulo/SP - Brasil
Telefone +55 (11) 3940-1500
kpmg.com.br

Relatório dos auditores independentes sobre as demonstrações financeiras

Aos Cotistas e à Administradora do
Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo
São Paulo - SP

Opinião

Examinamos as demonstrações financeiras do Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo ("Fundo"), administrado pela Caixa Econômica Federal, que compreendem o demonstrativo da composição e diversificação da carteira em 31 de dezembro de 2019 e a respectiva demonstração das evoluções do patrimônio líquido para o exercício findo nessa data, bem como as correspondentes notas explicativas, compreendendo as políticas contábeis significativas e outras informações elucidativas.

Em nossa opinião, as demonstrações financeiras acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Fundo em 31 de dezembro de 2019 e o desempenho de suas operações para o exercício findo nessa data, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos fundos de investimento regulamentados pela Instrução nº 555/14 da Comissão de Valores Mobiliários ("CVM").

Base para opinião

Nossa auditoria foi conduzida de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria. Nossas responsabilidades, em conformidade com tais normas, estão descritas na seção a seguir intitulada "Responsabilidades dos auditores pela auditoria das demonstrações financeiras". Somos independentes em relação ao Fundo de acordo com os princípios éticos relevantes previstos no Código de Ética Profissional do Contador e nas normas profissionais emitidas pelo Conselho Federal de Contabilidade, e cumprimos com as demais responsabilidades éticas de acordo com essas normas. Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opinião.

Principais assuntos de auditoria

Principais assuntos de auditoria são aqueles que, em nosso julgamento profissional, foram os mais significativos em nossa auditoria do exercício corrente. Esses assuntos foram tratados no contexto de nossa auditoria das demonstrações financeiras como um todo e na formação de nossa opinião sobre essas demonstrações financeiras e, portanto, não expressamos uma opinião separada sobre esses assuntos.



Custódia e valorização de ativos financeiros

Em 31 de dezembro de 2019, o Fundo possuía 100,01% do seu patrimônio líquido representado por aplicações em títulos públicos e operações compromissadas, mensurados ao valor justo e para os quais há preços cotados ou indexadores/parâmetros observáveis no mercado, registrados e custodiados em órgão regulamentado de liquidação e custódia ("Sistema Especial de Liquidação e Custódia – SELIC"). Devido ao fato desses ativos serem os principais elementos que influenciam o patrimônio líquido e o reconhecimento de resultado do Fundo, no contexto das demonstrações financeiras como um todo, consideramos esse assunto significativo em nossa auditoria.

Como nossa auditoria conduziu esse assunto

Os nossos procedimentos de auditoria incluíram, mas não estão limitados a:

- Teste de existência por meio de conciliação das posições mantidas pelo Fundo com as informações fornecidas pelo custodiante;
- Com auxílio de nossos especialistas em instrumentos financeiros, recalculamos a valorização dos ativos financeiros com base em preços disponíveis obtidos junto a fontes de mercado independentes ou informações observáveis no mercado; e
- Avaliação das divulgações efetuadas nas demonstrações financeiras do Fundo.

Com base nas evidências obtidas por meio dos procedimentos acima descritos, consideramos aceitáveis os saldos das aplicações em títulos públicos e operações compromissadas, no tocante à existência, mensuração, e respectivas divulgações, no contexto das demonstrações financeiras tomadas em conjunto, referentes ao exercício findo em 31 de dezembro de 2019.

Outras informações que acompanham as demonstrações financeiras e o relatório dos auditores

A administração do Fundo é responsável por essas outras informações que compreendem o demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio.

Nossa opinião sobre as demonstrações financeiras não abrange o demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio, e não expressamos qualquer forma de conclusão de auditoria sobre esse demonstrativo.

Em conexão com a auditoria das demonstrações financeiras, nossa responsabilidade é a de ler o demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio e, ao fazê-lo, considerar se esse demonstrativo está, de forma relevante, inconsistente com as demonstrações financeiras ou com nosso conhecimento obtido na auditoria ou, de outra forma, aparenta estar distorcido de forma relevante. Se, com base no trabalho realizado, concluirmos que há distorção relevante no demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio, somos requeridos a comunicar esse fato. Não temos nada a relatar a este respeito.

Responsabilidade da administração do Fundo pelas demonstrações financeiras

A administração é responsável pela elaboração e adequada apresentação das demonstrações financeiras de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos fundos de investimento regulamentados pela Instrução nº 555/14 da CVM e



pelos controles internos que ela determinou como necessários para permitir a elaboração de demonstrações financeiras livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro.

Na elaboração das demonstrações financeiras, a administração é responsável, dentro das prerrogativas previstas na Instrução nº 555/14 da CVM, pela avaliação da capacidade de o Fundo continuar operando, divulgando, quando aplicável, os assuntos relacionados com a sua continuidade operacional e o uso dessa base contábil na elaboração das demonstrações financeiras, a não ser que a administração pretenda liquidar o Fundo ou cessar suas operações, ou não tenha nenhuma alternativa realista para evitar o encerramento das operações.

Responsabilidades dos auditores pela auditoria das demonstrações financeiras

Nossos objetivos são obter segurança razoável de que as demonstrações financeiras, tomadas em conjunto, estão livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro, e emitir relatório de auditoria contendo nossa opinião. Segurança razoável é um alto nível de segurança, mas não uma garantia de que a auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria sempre detectam as eventuais distorções relevantes existentes. As distorções podem ser decorrentes de fraude ou erro e são consideradas relevantes quando, individualmente ou em conjunto, possam influenciar, dentro de uma perspectiva razoável, as decisões econômicas dos usuários tomadas com base nas referidas demonstrações financeiras.

Como parte da auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria, exercemos julgamento profissional, e mantemos ceticismo profissional ao longo da auditoria. Além disso:

- Identificamos e avaliamos os riscos de distorção relevante nas demonstrações financeiras, independentemente se causada por fraude ou erro, planejamos e executamos procedimentos de auditoria em resposta a tais riscos, bem como obtemos evidência de auditoria apropriada e suficiente para fundamentar nossa opinião. O risco de não detecção de distorção relevante resultante de fraude é maior do que o proveniente de erro, já que a fraude pode envolver o ato de burlar os controles internos, conluio, falsificação, omissão ou representações falsas intencionais.
- Obtemos entendimento dos controles internos relevantes para a auditoria para planejarmos procedimentos de auditoria apropriados às circunstâncias, mas não com o objetivo de expressarmos opinião sobre a eficácia dos controles internos da administradora do Fundo.
- Avaliamos a adequação das políticas contábeis utilizadas e a razoabilidade das estimativas contábeis e respectivas divulgações feitas pela Administradora.
- Concluímos sobre a adequação do uso, pela administração, da base contábil de continuidade operacional e, com base nas evidências de auditoria obtidas, se existe incerteza relevante em relação a eventos ou condições que possam levantar dúvida significativa em relação à capacidade de continuidade operacional do Fundo. Se concluirmos que existe incerteza relevante, devemos chamar atenção em nosso relatório de auditoria para as respectivas divulgações nas demonstrações financeiras ou incluir modificação em nossa opinião, se as divulgações forem inadequadas. Nossas conclusões estão fundamentadas nas evidências de auditoria obtidas até a data de nosso relatório.



Todavia, eventos ou condições futuras podem levar o Fundo a não mais se manter em continuidade operacional.

- Avaliamos a apresentação geral, a estrutura e o conteúdo das demonstrações financeiras, inclusive as divulgações e se as demonstrações financeiras representam as correspondentes transações e os eventos de maneira compatível com o objetivo de apresentação adequada.

Comunicamo-nos com a Administradora a respeito, entre outros aspectos, do alcance planejado, da época da auditoria e das constatações significativas de auditoria, inclusive as eventuais deficiências significativas nos controles internos que identificamos durante nossos trabalhos.

Dos assuntos que foram objeto de comunicação com a Administradora, determinamos aqueles que foram considerados como mais significativos na auditoria das demonstrações financeiras do exercício corrente e que, dessa maneira, constituem os principais assuntos de auditoria. Descrevemos esses assuntos em nosso relatório de auditoria, a menos que lei ou regulamento tenha proibido divulgação pública do assunto, ou quando, em circunstâncias extremamente raras, determinarmos que o assunto não deve ser comunicado em nosso relatório porque as consequências adversas de tal comunicação podem, dentro de uma perspectiva razoável, superar os benefícios da comunicação para o interesse público.

São Paulo, 30 de março de 2020

KPMG Auditores Independentes

CRC 2SP014428/O-6

Rodrigo Cruz Bassi

Contador CRC 1SP261156/O-7

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira

Em 31 de dezembro de 2019

(Em milhares de Reais)

Aplicações - Especificações	Quantidade	Custo total	Mercado/ realização	% sobre o patrimônio líquido
Disponibilidades	-	-	10	0,00
Operações compromissadas	410.589	-	372.413	3,79
Letras do Tesouro Nacional	410.589	-	372.413	3,79
Títulos federais	2.551.799	8.997.046	9.437.392	96,11
Letras Financeiras do Tesouro	99	1.036	1.036	0,01
Notas do Tesouro Nacional	2.551.700	8.996.010	9.436.356	96,09
Títulos em garantia de operações em bolsa	1.000	10.466	10.466	0,11
Letras Financeiras do Tesouro	1.000	10.466	10.466	0,11
Instrumentos financeiros derivativos	-	-	107	0,00
Contratos futuros - ajuste positivo	-	-	107	0,00
Valores a receber	-	-	1	0,00
Total do ativo			9.820.389	100,01
Valores a pagar	-	-	536	0,01
Patrimônio líquido			9.819.853	100,00
Total do passivo e patrimônio líquido			9.820.389	100,01

As notas explicativas da Administradora são parte integrante das demonstrações financeiras.

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Demonstrações das evoluções do patrimônio líquido
Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018
(Em milhares de Reais, exceto o valor unitário das cotas)

	31/12/19	31/12/18
Patrimônio líquido no início dos exercícios		
Total de 4.330.489.214 cotas a R\$ 2,655342 cada	11.498.930	
Total de 2.753.273.721 cotas a R\$ 2,421265 cada		6.666.405
Cotas emitidas		
1.180.364.817 cotas	3.282.053	-
2.696.770.219 cotas	-	6.885.087
Cotas resgatadas		
2.233.944.370 cotas	(5.448.734)	-
1.119.554.726 cotas	-	(2.359.759)
Variações no resgate das cotas	<u>(682.926)</u>	<u>(435.247)</u>
Patrimônio líquido antes do resultado dos exercícios	<u>8.649.323</u>	<u>10.756.486</u>
Composição do resultado dos exercícios		
A - Renda Fixa	<u>1.190.435</u>	<u>759.010</u>
Apropriação de rendimentos	688.908	659.177
Valorização a preço de mercado	501.903	99.813
Resultado nas negociações	(376)	20
B - Demais receitas	<u>456</u>	<u>13</u>
Receitas diversas	-	13
Ganhos com derivativos	456	-
C - Demais Despesas	<u>(20.361)</u>	<u>(16.579)</u>
Remuneração da administração	(19.405)	(15.895)
Auditoria e custódia	(749)	(610)
Perdas com derivativos	(131)	-
Taxa de fiscalização	(67)	(68)
Despesas diversas	(9)	(6)
Total do resultado dos exercícios	<u>1.170.530</u>	<u>742.444</u>
Patrimônio líquido no final dos exercícios		
Total de 3.276.909.661 cotas a R\$ 2,996681 cada	<u>9.819.853</u>	
Total de 4.330.489.214 cotas a R\$ 2,655342 cada		<u>11.498.930</u>

As notas explicativas da Administradora são parte integrante das demonstrações financeiras.

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras
Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018
(Em milhares de Reais)

1. Contexto operacional

O Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo (“Fundo”) teve iniciadas suas atividades em 9 de julho de 2010, sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração. O Fundo destina-se a acolher investimentos de Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pelos Estados, Municípios e Distrito Federal do Brasil, das Entidades Públicas da Administração Direta, Autarquias, Fundações Públicas, Entidades Fechadas de Previdência Complementar, Fundos de Investimento e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento administrados pela Administradora, Entidades Abertas de Previdência Complementar, Companhias Seguradoras e Sociedades de Capitalização, previamente cadastrados perante a Administradora e tem como objetivo proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos 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 é superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias.

As operações em mercados de derivativos devem ser realizadas exclusivamente para proteção da carteira, limitado a uma vez do o respectivo patrimônio líquido.

Os ativos financeiros que compõem a carteira do Fundo estão expostos diretamente ou por meio do uso de derivativos ao risco das variações das taxas de juros prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índice de preços, não havendo, necessariamente, um fator de risco principal.

Os cotistas estão sujeitos aos riscos inerentes aos mercados nos quais o Fundo aplica seus recursos, diretamente ou através dos fundos investidos. Existe a possibilidade de ocorrer redução da rentabilidade ou mesmo perda do capital investido no Fundo, em decorrência dos riscos de mercado, de crédito, de liquidez, de concentração, sistêmico e de regulação e proveniente do uso de derivativos. Mesmo que o Fundo possua um fator de risco principal poderá sofrer perdas decorrentes de outros fatores.

Os investimentos em fundos não são garantidos pela Administradora ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Créditos (FGC).

2. Apresentação e elaboração das demonstrações financeiras

As demonstrações financeiras foram preparadas de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos fundos de investimento regulamentados pela Instrução CVM nº 555/14, complementada pelas normas previstas no Plano Contábil dos Fundos de Investimento - COFI e pelas orientações emanadas da Comissão de Valores Mobiliários (CVM).

Foram utilizadas na elaboração dessas demonstrações financeiras, premissas e estimativas de preços para a determinação e contabilização dos valores dos ativos integrantes da carteira do Fundo. Dessa forma, quando da efetiva liquidação financeira desses ativos, os resultados auferidos poderão ser diferentes dos estimados.

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras
Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018
(Em milhares de Reais)

3. Descrição das principais práticas contábeis

A Administradora adota o regime de competência para o registro das receitas e despesas.

Entre as principais práticas contábeis adotadas destacam-se:

a) Operações compromissadas

As operações compromissadas referem-se à compra de títulos com o compromisso de revenda em data futura com rentabilidade ou parâmetro de remuneração estabelecido na data da contratação, ou seja, são aplicações financeiras, com lastro em títulos públicos federais, sendo realizadas sempre com instituições financeiras do mercado.

As operações compromissadas foram registradas pelo valor efetivamente pago e atualizadas diariamente pelo rendimento auferido com base na taxa de remuneração.

b) Títulos e valores mobiliários

De acordo com a Instrução CVM nº 577 de 7 de julho de 2016, os títulos e valores mobiliários estão classificados na categoria “Títulos para negociação”, considerando que foram adquiridos com o objetivo de serem negociados frequentemente e de forma ativa, sendo contabilizados pelo valor de mercado. Os ganhos e as perdas não realizados são reconhecidos no resultado do exercício.

c) Instrumentos financeiros derivativos

De acordo com a Instrução CVM nº 577 de 7 de julho de 2016 e regulamentações posteriores, as operações com instrumentos financeiros derivativos são registradas da seguinte forma:

i. *Na data da operação*

Os instrumentos financeiros derivativos são registrados em contas de ativo ou passivo de acordo com as características do contrato.

ii. *Diariamente*

Ajustados pelo valor de mercado dessas operações, sendo os seus ganhos e perdas reconhecidas no resultado, nas rubricas “Ganhos com derivativos” e “Perdas com derivativos”.

4. Títulos e valores mobiliários

a) Composição da carteira e premissas adotadas na determinação do valor de mercado

Títulos prefixados

Títulos públicos federais prefixados

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018

(Em milhares de Reais)

A avaliação é realizada por meio do desconto do fluxo financeiro pelas taxas divulgadas pela ANBIMA.

Títulos públicos federais indexados ao índice de preços

A avaliação é realizada com base no critério denominado desconto de fluxo de caixa, o qual é atualizado pela variação do índice (IPCA/IGPM) entre o mês anterior ao da emissão e o mês anterior ao da avaliação. Na falta do índice definitivo é efetuada “pro-rata” da projeção do índice disponibilizada pela ANBIMA. Este desconto é efetuado pela taxa divulgada pela ANBIMA.

Em 31 de dezembro de 2019, os títulos da carteira própria do Fundo, que se encontram registrados na categoria “títulos para negociação”, estão distribuídos conforme quadro a seguir:

Títulos públicos federais	Valor de curva	Valor de mercado	Ganhos/(perdas) não realizadas	Faixas de vencimento
Letras Financeiras do Tesouro	10.466	10.466	-	3 a 5 anos
Letras Financeiras do Tesouro	1.036	1.036	-	Acima de 5 anos
Total Letras Financeiras do Tesouro	11.502	11.502	-	
Notas do Tesouro Nacional – Série B	1.031.359	1.045.983	14.624	7 a 12 meses
Notas do Tesouro Nacional – Série B	4.122.506	4.350.788	228.282	1 a 3 anos
Notas do Tesouro Nacional – Série B	3.842.146	4.039.585	197.439	3 a 5 anos
Total Notas do Tesouro Nacional – Série B	8.996.011	9.436.356	440.345	
Total Títulos Públicos	9.007.513	9.447.858	440.345	

b) Mercado de derivativos

As operações em mercados de derivativos foram utilizadas com o objetivo de adequar a carteira do Fundo à política de investimento do mesmo, até o limite das posições detidas à vista.

Contratos futuros

São ajustados diariamente conforme ajustes de contratos futuros, divulgados pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

Os resultados líquidos com operações de futuros no exercício totalizaram R\$ 325 (não houveram operações em 2018) e os seus valores brutos estão registrados em “Demais receitas - ganhos com derivativos” e “Demais despesas - perdas com derivativos”.

Em 31 de dezembro de 2019, as operações no mercado futuro estavam distribuídas conforme quadro a seguir:

Futuros	Ativo	Passivo	Valor de referência (*)	Faixas de vencimento
DAP	107	-	170.189	1 a 3 anos
	107	-	170.189	

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos

Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras
Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018
(Em milhares de Reais)

c) Margem de garantia

Em 31 de dezembro de 2019, o Fundo possuía margens de garantia, representadas conforme abaixo:

Tipo Ativo	Quantidade	Valor	Vencimento
Letras Financeiras do Tesouro	1.000	10.466	3 a 5 anos
Total de Margem de Letras Financeiras do Tesouro	1.000	10.466	

5. Gerenciamento de riscos

O Fundo está exposto a diversos tipos de risco que podem ser resumidos em: mercado (risco decorrente de oscilações nos preços dos ativos, em virtude de flutuações nas taxas de juros, índices de preços, taxas de câmbio, preços das ações ou índices do mercado acionário, mudanças nas correlações etc.); crédito (risco dos emissores não cumprirem suas obrigações de pagamento do principal e os juros de suas dívidas); liquidez (risco do Fundo não ter recursos necessários para o cumprimento de suas obrigações, dentro dos prazos legais, em decorrência de condições de mercado); uso de derivativos (como os instrumentos derivativos são influenciados pelos preços à vista dos ativos a eles relacionados, pelas expectativas futuras de preços, liquidez dos mercados, além do risco de crédito da contraparte).

Para o controle do risco de mercado, o modelo estatístico utilizado é o VaR (Value at Risk) juntamente com o "Stress Analysis". O controle do risco de crédito é realizado por meio de uma política de crédito e um processo de análise dos emissores dos ativos financeiros atendendo a política de investimento do Fundo. O gerenciamento do risco de liquidez é feito através do controle e monitoramento do fluxo de caixa, dos indicadores de liquidez, do cronograma de vencimentos de ativos e do perfil de distribuição das aplicações do Fundo.

Visando o controle do risco, as decisões de investimentos do Fundo são tomadas por meio de comitês mensais, que têm como função analisar o cenário macroeconômico a fim de auxiliar a definir estratégias de alocação e reavaliá-las. Diariamente, são analisados os mercados de atuação para auxiliar as estratégias de compra e venda de ativos.

A área de gerenciamento e monitoramento de risco é completamente separada da área de gestão.

As operações com instrumentos derivativos atenderam aos objetivos propostos no regulamento do Fundo.

Análise de Sensibilidade

O Valor em Risco ou VaR (Value at Risk) é uma ferramenta de gerenciamento de risco de mercado que, por meio de técnicas estatísticas, mensura a estimativa de perda máxima potencial dentro de um determinado período e dado um intervalo de confiança em

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras
Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018
(Em milhares de Reais)

condições normais de mercado. Para obtenção do VaR do Fundo foi utilizado o modelo paramétrico com grau de confiança de 95% para um intervalo de tempo de 21 dias. O objetivo do método utilizado pelo administrador, portanto, é quantificar a perda máxima esperada para a carteira do Fundo conforme os parâmetros definidos no parágrafo acima. Cabe ressaltar, no entanto, as limitações deste método, uma vez que ele não fornece a medida da pior perda absoluta, mas uma estimativa de perda para um dado nível de confiança.

Data Base	Patrimônio Líquido do Fundo	Valor em Risco (Var)
31/12/2019	9.819.853	1,6845%

6. Emissões e resgates de cotas

As movimentações de aplicação e resgate são efetuadas em conta do aplicador, em moeda corrente nacional, observadas as seguintes condições:

Carência	Apuração da Cota	Periodicidade de Cálculo do Valor da Cota	Liquidação Financeira da Aplicação	Conversão de Cotas da Aplicação	Conversão de Cotas do Resgate	Liquidação Financeira do Resgate
Não há	No fechamento dos mercados em que o Fundo atue	Diária	D+0 da solicitação	D+0 da solicitação	D+0 da solicitação	D+0 da solicitação

A efetiva disponibilização do crédito ocorre em horário que não sejam permitidas as movimentações bancárias devido à necessidade de se aguardar o fechamento dos mercados em que o Fundo atua para o cálculo do valor da cota.

Os feriados de âmbito estadual ou municipal na praça sede da Administradora em nada afetarão as movimentações de aplicação e resgate solicitadas nas demais praças em que houver expediente bancário normal.

7. Custódia

Os títulos públicos, incluindo os utilizados como lastro para operações compromissadas, são escriturais e estão registrados no SELIC - Sistema Especial de Liquidação e Custódia, e as operações de futuros estão registrados na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

8. Remuneração da Administradora

A taxa de administração consiste no somatório das remunerações devidas pelo Fundo à Administradora e a cada um dos prestadores dos seguintes serviços contratados pelo Fundo, se houver: gestão da carteira, consultoria de investimento, tesouraria, controladoria, distribuição de cotas, escrituração de emissão e resgate de cotas e agência

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras
Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018
(Em milhares de Reais)

classificadora de risco.

A taxa de administração do Fundo é de 0,20% (vinte centésimos por cento) ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do Fundo, vedada qualquer participação nos resultados distribuídos ou investidos pelo Fundo.

A taxa de administração é calculada e provisionada a cada dia útil, à razão de 1/252 avos, multiplicada pelo patrimônio líquido do Fundo do dia útil imediatamente anterior e paga semanalmente à Administradora.

A correspondente despesa, no exercício, foi de R\$ 19.405 (2018 - R\$ 15.895).

Não são cobradas taxas de ingresso e saída do Fundo, nem taxa de performance.

9. Gestão, custódia e controladoria

Os serviços de gestão, custódia e controladoria são executados pela Caixa Econômica Federal.

10. Transações com partes relacionadas

As transações com partes relacionadas se referem à intermediação de compras e vendas finais de títulos públicos e a compras com compromisso de revenda de títulos públicos na gestão diária das disponibilidades do Fundo.

As operações do Fundo são feitas por intermédio de corretoras membros das Bolsas de Valores, ou intermediadas pela Administradora, assim como as operações compromissadas. Não há títulos privados emitidos por empresas ligadas a Administradora ou ao gestor na carteira do Fundo em 31 de dezembro de 2019.

No exercício findo em 31 de dezembro de 2019 foram realizadas, de forma equitativa, as seguintes transações com a Administradora:

Operações Compromissadas com partes relacionadas – Caixa Econômica Federal			
Mês/Ano	Operações compromissadas realizadas com partes relacionadas/ total de operações compromissadas	Volume médio diário/ Patrimônio médio diário do fundo	Taxa Média contratada/ Taxa SELIC
01/2019	100,00%	1,73%	99,77%
02/2019	100,00%	1,98%	99,77%
03/2019	100,00%	2,58%	99,77%
04/2019	100,00%	2,91%	99,77%
05/2019	100,00%	2,05%	99,77%
06/2019	100,00%	1,11%	99,77%
07/2019	100,00%	1,23%	99,77%
08/2019	100,00%	1,24%	99,75%
09/2019	100,00%	1,46%	99,74%
10/2019	100,00%	1,45%	99,72%
11/2019	100,00%	1,46%	99,69%
12/2019	100,00%	2,23%	99,67%

Operações de compra e venda definitivas de títulos públicos federais – Caixa Econômica Federal

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018

(Em milhares de Reais)

Mês/Ano	Operações definitivas de compra e venda de títulos públicos federais realizadas com partes relacionadas/ total de operações definitivas com títulos públicos federais	Volume médio diário/ patrimônio médio diário do fundo	(Preço praticado/preço médio do dia *) ponderado pelo volume
01/2019	44,57%	0,87%	100,01%
02/2019	15,91%	0,06%	99,99%
03/2019	53,02%	0,07%	100,03%
04/2019	73,99%	0,17%	99,99%
05/2019	19,25%	0,19%	100,00%
06/2019	15,78%	0,09%	99,97%
07/2019	19,80%	0,13%	100,04%
08/2019	8,56%	0,04%	100,07%
09/2019	17,29%	0,02%	99,92%
10/2019	16,05%	0,04%	100,09%
11/2019	11,86%	0,02%	100,10%
12/2019	18,17%	0,08%	100,00%

Em 31 de dezembro de 2019 o saldo de operações compromissadas com partes relacionadas apresente o montante de R\$ 372.413 (2018 - R\$ 286.945), sendo reconhecida durante o exercício uma receita com as operações compromissadas de R\$ 9.832 (2018 - R\$ 10.773).

O Fundo mantém em 31 de dezembro de 2019 o montante de R\$ 466 (2018 - R\$ 452) relativo à taxa de administração a pagar a Administradora, sendo que foi reconhecida durante o exercício uma despesa com taxa de administração de R\$ 19.405 (2018 - R\$ 15.895).

11. Legislação tributária

As operações da carteira do Fundo não estão sujeitas ao Imposto de Renda e sujeitam-se a alíquota zero de IOF - Títulos e Valores Mobiliários, conforme decreto nº 6.306, de 14 de dezembro de 2007.

Os cotistas não estão sujeitos à retenção na fonte de imposto de renda, conforme legislação tributária e fiscal vigente. No caso de resgate, incidirá IOF regressivo conforme o prazo de aplicação.

12. Política de distribuição de resultados

Eventuais resultados relativos a ativos componentes da carteira do Fundo são incorporados ao seu respectivo patrimônio, quando do seu pagamento ou distribuição pelos emissores de tais ativos.

13. Política de divulgação das informações

A divulgação das informações do Fundo ao cotista é realizada de acordo com a legislação em vigor através de correspondência, inclusive por meio eletrônico e canais eletrônicos, incluindo a rede mundial de computadores.

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos

Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018

(Em milhares de Reais)

14. Outras informações

- a) A rentabilidade do Fundo nos últimos dois exercícios e o valor da cota nos encerramentos dos mesmos foram os seguintes:

Data	Valor da cota - R\$	Rentabilidade (%)	Benchmark (%)
Exercício findo em 31 de dezembro de 2019	2,996681	12,85	13,15
Exercício findo em 31 de dezembro de 2018	2,655342	9,67	9,87

A rentabilidade passada não é garantia de rentabilidade futura.

O Fundo utiliza como *benchmark* a variação acumulada do subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B 5 - IMA-B 5.

15. Demandas judiciais

Não há registro de demandas judiciais ou extrajudiciais, quer na defesa dos direitos dos cotistas, quer desses contra a administração do Fundo.

16. Outros serviços prestados pelos auditores independentes

Em atendimento à Instrução nº 381/03 da Comissão de Valores Mobiliários, registre-se que a Administradora, no exercício, não contratou nem teve serviços prestados pela KPMG Auditores Independentes, relacionados a este Fundo de Investimento por ela administrada que não os serviços de auditoria externa, em patamares superiores a 5% do total dos custos de auditoria externa. A política adotada atendeu aos princípios que preservam a independência do auditor, de acordo com os critérios internacionalmente aceitos, quais sejam, o auditor não deve auditar o seu próprio trabalho, nem exercer funções gerenciais no seu cliente ou promover os interesses deste.

17. Alterações estatutárias

A Assembleia Geral Extraordinária de 19 de agosto de 2019 deliberou sobre alterar as movimentações do Fundo, de modo que, nos feriados na Cidade ou no Estado de São Paulo ou dias em que o mercado financeiro ou as bolsas de valores ou de mercadorias não estiverem em funcionamento, a Administradora não acatará pedidos de aplicação e de resgates no Fundo, independente da praça em que os cotistas estiverem localizados.

18. Evento subsequente

Desde o início de janeiro de 2020, o surto de coronavírus, que é uma situação em rápida evolução, impactou adversamente as atividades econômicas globais. O rápido desenvolvimento e fluidez dessa situação impedem qualquer previsão como seu impacto final. Adicionalmente, certas ações da Organização dos Países Exportadores de Petróleo e a Rússia também trouxeram aumento na volatilidade nos mercados financeiros e de

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Exercícios findos em 31 de dezembro de 2019 e 2018

(Em milhares de Reais)

capitais. Estes eventos podem ter um impacto adverso contínuo nas condições econômicas e de mercado e desencadear um período de desaceleração econômica global, o que poderia trazer reflexos na precificação subsequente da carteira do Fundo, cuja a quota vem sendo divulgada diariamente ao mercado. A Administradora não acredita que haja impacto financeiro nas demonstrações financeiras em 31 de dezembro de 2019, como resultado destes eventos subsequentes, e estão monitorando os desenvolvimentos relacionados ao coronavírus e coordenando sua resposta operacional com base nos planos de continuidade de negócios existentes e nas orientações de organizações globais de saúde, governos relevantes e melhores práticas gerais de resposta à pandemia.

19. Informações adicionais

O diretor e o contabilista responsáveis pelo Fundo na data base são os seguintes:

Daniel Boueres Sandoval
Diretor Responsável

Luis César Belchior Guimarães
Contador - CRC DF - 015449/O-9

Fundo de Investimento Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo

CNPJ: 11.060.913/0001-10

(Administrado pela Caixa Econômica Federal - CNPJ: 00.360.305/0001-04)

Exercício findo em 31 de dezembro de 2019

Demonstrativo das evoluções do valor da cota e patrimônio líquido médio

A evolução do valor da cota no último dia útil de cada um dos últimos doze meses, as respectivas variações mensais e acumuladas para cada mês e a evolução do *benchmark*, foram os seguintes:

Mês	Valor da cota (R\$)	PL médio mensal (R\$ mil)	Variação no mês (%)	Variação Acumulada (%)	<u>Benchmark - IMAB 5</u>	
					Variação no mês (%)	Variação Acumulada (%)
31/12/2018	2,655342	-	-	-	-	-
31/01/2019	2,696046	8.992.194	1,53	1,53	1,54	1,54
28/02/2019	2,710170	8.837.460	0,52	2,06	0,55	2,09
29/03/2019	2,730888	9.055.508	0,76	2,85	0,78	2,90
30/04/2019	2,760330	9.285.033	1,08	3,95	1,11	4,03
31/05/2019	2,798154	9.656.398	1,37	5,38	1,39	5,47
28/06/2019	2,845674	9.798.420	1,70	7,17	1,72	7,28
31/07/2019	2,872628	10.015.527	0,95	8,18	0,97	8,33
30/08/2019	2,873631	10.023.119	0,03	8,22	0,05	8,38
30/09/2019	2,923061	9.989.957	1,72	10,08	1,74	10,27
31/10/2019	2,970976	10.089.473	1,64	11,89	1,65	12,09
29/11/2019	2,960969	10.096.314	(0,34)	11,51	(0,28)	11,77
31/12/2019	2,996681	9.925.169	1,21	12,85	1,24	13,15

A rentabilidade passada não é garantia de rentabilidade futura.

O Fundo utiliza como *benchmark* a variação acumulada do subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B 5 - IMA-B 5.



ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

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

Nome Fundo	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP			CNPJ	11.060.913/0001-10
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	001	CNPJ	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Cred.	001	CNPJ	00.360.305/0001-04
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ	00.360.305/0001-04

Classificação do Fundo Resolução CMN 4.604/2017:

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

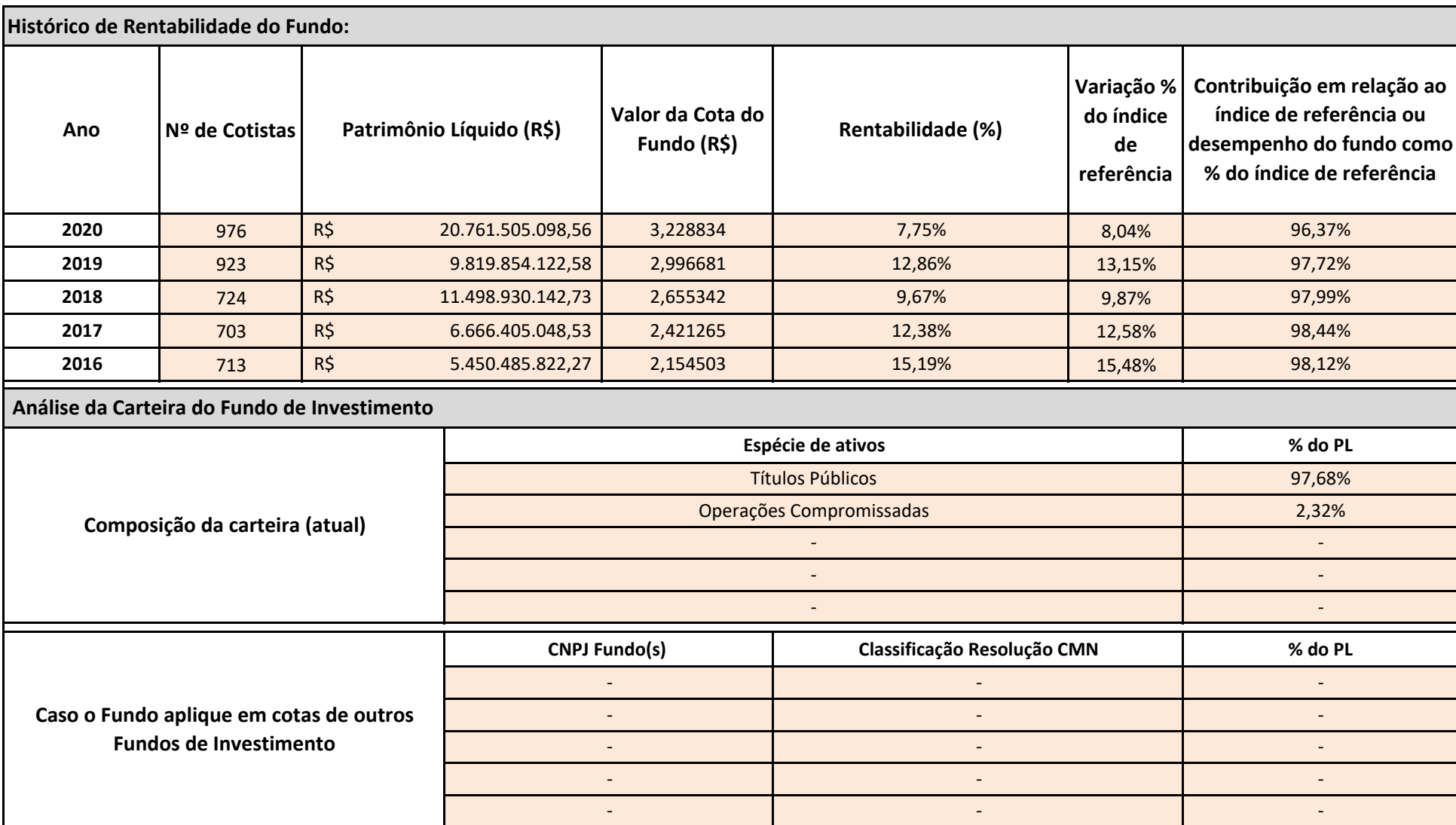
Identificação dos documentos analisados referentes ao Fundo:	Data do Documento	Página na internet em que o documento foi consultado ou disponibilizado pela instituição
1. Questionário Padrão Due Diligence para Fundo de Investimento – Seção 2 da ANBIMA	31/12/2019	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx
2. Regulamento	17/10/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
3. Lâmina de Informações essenciais	12/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
4. Formulário de informações complementares	14/09/2018	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
5. Perfil Mensal	12/2020	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg
6. Demonstração de Desempenho	Referente a 2020	https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/rpps/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx



7. Relatórios de Rating	-	Não Disponibilizado pela Instituição.	
8. Demonstrações Contábeis	31/12/2019	https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg	
II.5 Forma de Distribuição do Fundo (art.3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)			
Nome/Razão Social do distribuidor:	Caixa Econômica Federal		
CPF/CNPJ:	00.360.305/0001-04		
Informações sobre a Política de Distribuição:	Eventuais resultados relativos a ativos componentes da carteira do FUNDO serão incorporados ao seu respectivo patrimônio, quando do seu pagamento ou distribuição pelos emissores de tais ativos.		
Resumo das informações do Fundo de Investimento			
Data de Constituição:	30/07/2009	Data de Início das Atividades:	09/07/2010
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referencia/objetivo de rentabilidade		
	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos		
	federais, buscando acompanhar o 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.		
Público-alvo:	Regimes Próprios de Previdência Social		
Condições de Investimento (Prazos/Condições para resgate)	Prazo de Duração do Fundo		Indeterminado
	Prazo de Carência (dias)		0
	Prazo para Conversão de Cotas (dias)		0
	Prazo para Pagamento dos Resgates (dias)		0
	Prazo Total (dias)		0



Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada (%)		0
	Taxa de saída (%)		0
	Taxa de Administração (%)		0,20% a.a.
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d'água
	Não Possui	Não se aplica	Não se aplica
Aderência do Fundo aos quesitos estabelecidos na Resolução do CMN relativos, dentre outros, aos gestores e administradores do fundo, aos ativos de crédito privado que compõem sua carteira	Nos últimos dois anos, o fundo de investimento rentabilizou 23,77%, enquanto seu benchmark rentabilizou no mesmo período 24,31%, se mostrando aderente ao seu Benchmark. O fundo não possui prazo de carência, mostrando compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do RPPS. O Índice de Liquidez do Fundo foi obtido por meio do somatório dos índices de liquidez apurados para cada ativo ou grupo de ativos financeiros.		
Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo:	Não Houve		
Análise de fatos relevantes divulgados:	Não Houve		
Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos:	O fundo se encontra aderente ao perfil da carteira e a Política de Investimentos do RPPS.		
Principais riscos associados ao Fundo:	Risco de Mercado; Risco de Crédito; Risco de Liquidez; Risco de Concentração; Risco Sistemico e de Regulação e Risco Proveniente do uso de Derivativos.		





	Emissor (CPF/CNPJ)	Classificação Resolução CMN	% do PL
Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
Carteira do Fundo é aderente à Política de Investimentos estabelecida em seu regulamento e com a classificação na Resolução CMN	SIM		
Prazo médio da carteira de títulos do Fundo (em meses (30) dias)	30,33		
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	O fundo não possui prazo de carência, mostrando compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do RPPS.		
Nota de Risco de Crédito	Agência de risco		Nota
	Fitch Rating		Forte
Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	O fundo analisado possui características de acordo com a Política de Investimentos do RPPS e sua compatibilidade ao perfil da carteira comparado com os demais fundos distribuídos no mercado, com os mesmo índice de Benchmark.		



Comentários Adicionais

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

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

Data:

02/01/2021

Responsáveis pela Análise:

Cargo

CPF

Assinatura