

**ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<sup>1</sup>**

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

<sup>1</sup> Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância das condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência e os requisitos e limites previstos na Resolução do CMN, a aderência à Política Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

Nome Fundo	CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES			CNPJ FUNDO	15.154.220/0001-47
Administrador	Caixa Econômica Federal	Nº Termo Credenciamento	001/2022	CNPJ ADM	00.360.305/0001-04
Gestor	Caixa DTVM	Nº Termo Credenciamento	001/2024	CNPJ GES	42.040.639/0001-40
Custodiante	Caixa Econômica Federal			CNPJ CUST	00.360.305/0001-04

**Classificação do Fundo Resolução CMN 4.963/2021**

	Títulos Públicos - Art. 7º, I, "a"	<b>X</b>	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I
	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b		Fundos de Investimento em Índices de Mercado (ETF) - Renda Variável - Art. 8º, II
	ETF - 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c		Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I
	Operações Compromissadas - Art. 7º, II		Fundos de Investimento - Investimento no Exterior - Art. 9º, II
	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a		Fundos de Investimento em Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III
	ETF - Demais Indicadores de RF - Art. 7º, III, b		Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I
	Ativos Financeiros de RF - Art. 7º, IV		FI em Participações - Art. 10º, II
	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, V, a		Ações - Mercado de Acesso - Art. 10º, III
	FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, V, b		FI Imobiliário - Art. 11º
	FI Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, V, c		Empréstimos Consignados - Art. 12º

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 ANBIMA de due diligence para contratação de gestor de recursos de terceiros – ANEXO I – Fundos de Investimento	31/12/2022	<a href="https://www.caixa.gov.br/caixa-asset/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx">https://www.caixa.gov.br/caixa-asset/credenciamento-rpps/Paginas/default.aspx</a>
2. Regulamento	15/09/2022	<a href="https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx">https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx</a>
3. Lâmina de Informações essenciais	01/12/2023	<a href="https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx">https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx</a>
4. Formulário de informações complementares	17/05/2023	<a href="https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx">https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx</a>
5. Perfil Mensal	01/12/2023	<a href="https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx">https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx</a>
6. Demonstração de Desempenho	30/06/2023	<a href="https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx">https://www.caixa.gov.br/fundos-investimento/voce/Paginas/default.aspx</a>
7. Relatórios de Rating		
8. Demonstrações Contábeis	01/09/2022	

**II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)**

Nome/Razão Social do distribuidor:	N/A
CPF/CNPJ:	N/A
Informações sobre a Política de Distribuição:	N/A

**Resumo das informações do Fundo de Investimento**

Data de Constituição:	01/11/2012	Data de Início das Atividades:	01/11/2012
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade	SMLL	
	Aplica seus recursos em carteira composta por ativos de empresas de menor capitalização no mercado, baseando-se em cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.		
Público-alvo do Fundo:	Investidores em geral		
Condições de Investimento (Prazos/Condições para resgate)	Prazo Duração do Fundo	Indeterminado	
	Prazo de carência	Não há	
	Prazo para conversão de cotas (dias)	D+1 du dias úteis	
	Prazo para pagamento dos resgates (dias)	D+3 du dias úteis	
	Prazo Total (dias)	D+3 dias úteis	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada	Não há	
	Taxa de saída	Não há	
	Taxa de administração	1,50%	
	Taxa de Performance		
	Índice de referência	Não possui	Frequência
		Linha-d água	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:	Fundo enquadrado na Resolução CMN nº 4.963/2021 e alterações posteriores.
Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo:	N/A
Análise de fatos relevantes divulgados:	Não houve divulgação de fatos relevantes.
Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos:	Esta análise visa a atualização do credenciamento, entretando o Fundo encontra-se em monitoramento devido a performance negativa em relação ao benchmark apresentada desde o início da pandemia.
Principais riscos associados ao Fundo:	RISCO DE MERCADO ; RISCO DE LIQUIDEZ ; RISCO DE CREDITO ; RISCO DE DERIVATIVOS ; RISCO DE CONCENTRAÇÃO (Vide Regulamento)

**Histórico de Rentabilidade do Fundo:**

Ano	Nº de Cotistas	Patrimônio Líquido (PL) (R\$)	Valor da Cota do Fundo (R\$)	Rentabilidade (%)	Varição % do índice de referência	Contribuição em relação ao índice de referência/ ou Desempenho do fundo como % do índice de referência
2022	6919	569.834.602,44	1,364647	-15,33%	-15,06%	

2021	10347	889.447.105,88	1,611693	-17,13%	-16,20%	
2020	15069	1.388.354.610,95	1,944823	-3,23%	-0,65%	
2019	12392	1.147.989.407,83	2,009736	54,75%	58,20%	94,07%
2018	2186	210.339.705,98	1,298696	5,01%	8,13%	61,62%

#### Análise da Carteira do Fundo de Investimento

Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos	% do PL
	Ações	98,98%
	Fundos de Investimento	0,78%
	Valores a pagar/receber	0,24%
	Outros	0,00%

Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ desse(s) Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL do Fundo
	1. 05.164.375/0001-00	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a	0,78%
	2.		
	3.		
	4.		
	5.		

Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)	Tipo de Emissor	% do PL 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)	12,2
--	------

Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS	Sim, porém, não a necessidade de Atestado de compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate.
--	--

Nota de Risco de Crédito	Agência de risco	Nota
	N/A	N/A

Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:	Fundo dentro dos critérios de credenciamento exigidos pelo FAPES/TOLEDOPREV, sendo a atualização do credenciamento aprovada pelo comitê de investimentos.
---	---

Comentários Adicionais	O Fundo analisado de acordo com a Resolução CMN 4.963/2021 esta classificado no Art. 8º I.
------------------------	--

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.

Responsáveis pela Análise:		Data: 05/01/2024	
	Cargo	CPF	Assinatura
JALDIR ANHOLETO	Presidente do Conselho Fiscal	702.494.239-87	
LEANDRO MARCELO LUDVIG	Presidente do Conselho de Administração	061.448.469-30	
WILMAR DA SILVA	Membro do Comitê de Investimentos	525.047.949-91	
ROSELI FABRIS DALLA COSTA	Coordenadora do TOLEDOPREV	627.600.339-53	
TATIANE MENDES BERTO DA SILVA	Membro do Comitê de Investimentos	039.351.739-03	