

ANEXO I – FUNDOS DE INVESTIMENTO

1. Alterações desde a última atualização

|  |   |  |
|--|---|--|
| 1.1  | Nome do fundo   |  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA |   |  |
| 1.2  | CNPJ  |  |
| 01.525.057/0001-77   |   |  |
| 1.3  | Data de início  |  |
| 15/01/1997   |   |  |
| 1.4  | Classificação ANBIMA  |  |
| Ações Indexados  |   |  |
| 1.5  | Código ANBIMA   |  |
| 41025  |   |  |
| 1.6  | O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?  |  |
| Não  |   |  |
| 1.7  | Classificação tributária (CP/LP/Ações)  |  |
| Ações  |   |  |
| 1.8  | Descreva o público-alvo.  |  |
| Investidores em geral  |   |  |
| 1.9  | O regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução do CMN? |  |
| Este Regulamento está adequado às normas estabelecidas para os RPPS.             |   |  |
| 1.10   | Conta corrente (banco, agência, nº)   |  |
| 0238-050-00000002/8  |   |  |
| 1.11   | Conta CETIP (nº)  |  |
| N/A  |   |  |
| 1.12   | Administração (indique contato para informações).   |  |
| Caixa Econômica Federal  |   |  |
| 1.13   | Custódia (indique contato para informações).  |  |
| Caixa Econômica Federal  |   |  |
| 1.14   | Auditoria externa   |  |
| KPMG   |   |  |
| 1.15   | Caso se aplique, informar:  |  |
|  | Escriturador  |  |
|  | Custodiante   |  |
|  | Consultor Especializado   |  |
|  | Assessor Jurídico   |  |
|  | Co-gestor   |  |
|  | Distribuidor  |  |
|  | Outros  |  |
| 1.16   | Cotização: abertura ou fechamento?  |  |
| Fechamento   |   |  |

|            |  |                         |
|------------|--|-------------------------|
| 1.17       | Regras para aplicação e resgate:   |                         |
|            | Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)  | 17:00   D+1 du   D+0    |
|            | Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.                              | Não há                  |
|            | Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)  | 17:00   D+1 du   D+3 du |
|            | Aplicação inicial mínima   | 0,00                    |
|            | Aplicação máxima por cotista   | N/A                     |
|            | Aplicação adicional mínima   | 0,00                    |
|            | Resgate mínimo   | 0,00                    |
|            |  |                         |
| 1.18       | Taxa de Entrada (upfront fee)  |                         |
| N/A        |  |                         |
| 1.19       | Taxa de Saída (redemption fee)   |                         |
| Não possui |  |                         |
| 1.20       | Taxa de administração  |                         |
| 2,00%      |  |                         |
| 1.21       | Taxa de administração máxima   |                         |
| 2,00%      |  |                         |
| 1.22       | Taxa de custódia máxima  |                         |
| N/A        |  |                         |
| 1.23       | Taxa de Performance  |                         |
|            | % (Percentual)   | Não possui              |
|            | Benchmark  | Não possui              |
|            | Frequência   | Não se aplica           |
|            | Linha-d’água (sim ou não)  | Não se aplica           |
|            | Método de cálculo (ativo/passivo/ajuste)   | Não se aplica           |
|            |  |                         |
| 1.24       | Despesas do fundo pagas ao grupo econômico do administrador (e da gestora, se este for diferente) excluindo-se as taxas de Administração e de Performance. |                         |
| N/A        |  |                         |
| 1.25       | Há acordo de remuneração com cláusula de reversão de rebate para o fundo? (pagamento e/ou recebimento).  |                         |
| N/A        |  |                         |

2. Perfil

|   |   |
|---|---|
| 2.1   | Descreva o fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.    |
| Aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimentos de ações.   |   |
| 2.2   | Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do fundo. |
| N/A   |   |
| 2.3   | Descreva o processo decisório de investimento deste fundo de investimento.                                |
| As decisões de alocação são tomadas em comitê, que se reúne para avaliar as tendências do mercado e as condições macroeconômicas e microeconômicas, levando em consideração os níveis e limites de risco definidos no regulamento do fundo. |   |

## 2.4 Cite as premiações, ratings e rankings dos últimos 05 anos.

Premiada pelo Guia EXAME –Investimentos Pessoais – por 13 anos consecutivos (2004 – 2016) também, foi eleita uma das maiores gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset – AGO 17, realizado pela revista Investidor Institucional. Conquistou a posição de maior gestora em duas categorias: Maior Gestor de FIPs Maior Gestor de RPPS;

Prêmio MBI Melhor Banco para Investir – Melhor Gestor de Renda Fixa e Melhor Gestor de Ações – Fev./2018;

Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas - 2º Melhor Gestor Geral e Melhor Gestor em Fundos Balanceados até 15 - edição 2018 do Guia de Previdência Valor/FGV;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Março/2018) - 5 Fundos Classificados como excelentes;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Agosto/2018) - 4 Fundos Classificados como excelentes;

Ranking Exame – Onde Investir 2019 - 2º Melhor Gestor de Varejo;

Prêmio MBI/FGV – Melhor Banco para Investir - 2ª melhor gestor em Fundos Money Market e 2ª melhor gestor de fundos multimercados FEV/19;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 312 – Março/2019) –9 Fundos classificados como excelentes;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 317 –Agosto/2019) – CAIXA no 2º lugar no Ranking de Gestores com 22 Fundos classificados como excelentes;

Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas – CAIXA como Gestora Destaque em Fundos Balanceados até 15 - Edição 2019;

Ranking Exame – Onde Investir 2020 – 3º Melhor Gestor de Renda Fixa, 3º Melhor Gestor de Fundos DI e Curto Prazo e 3º Melhor Gestor de Fundos de Varejo;

Prêmio MBI/FGV – Melhor Banco para Investir - 1ª melhor gestor de fundos multimercados, 1ª melhor gestor de fundos de ações, 2ª melhor gestor em Fundos Money Market e 2ª melhor gestor em Fundos de Renda Fixa FEV/20;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 323 – Março/2020) – 10 Fundos classificados como excelentes;

Valor Investe – Julho/2020 - A CAIXA teve 3 fundos de renda fixa listados pelo Valor Investe dentre os melhores do semestre. No grupo “Renda Fixa Ativa”: CAIXA FIC Brasil Gestão Estratégica RF e o CAIXA FIC; Objetivo Prefixado RF LP. No grupo “Juro Real”: CAIXA FIC Foco Índice de Preços RF LP;

Ratings Morningstar - Agosto/2020: CAIXA Alocação Macro FIC FIM LP considerado 5 estrelas no ranking;

Premiação Valor – Agosto/Setembro/2020;

Fundos CAIXA listados no Ranking do Guia de Fundos Valor entre os 10 fundos com melhor retorno do mercado: CAIXA FIC Alocação Macro Multimercado LP, CAIXA FIC Pré Objetivo RF LP, CAIXA FI Fidelidade RF LP; CAIXA FI Ações BDR nível I e CAIXA FI FIDELIDADE II Crédito Privado LP;

Os Melhores Fundos Para Institucionais - Ranking – Revista Investidor Institucional – Agosto/Setembro;

A CAIXA teve 16 fundos premiados como EXCELENTE pelo ranking “Os Melhores Fundos para Institucionais”, da revista Investidor Institucional em agosto/20;

Além do destaque positivo no Ranking Os Melhores Fundos Para Institucionais, a edição de setembro da publicação consolida a liderança CAIXA no segmento RPPS, através do Ranking TOP Asset;

2022 – Destaque no Guia de Previdência Valor/FGV, 2º lugar no Ranking Valor Econômico de Previdência, 2º Melhor Renda Fixa Guia Fundos FGV, 3º Melhor Money Market Guia Fundos FGV, Top Asset Investidor; Institucional com 20 fundos excelentes, Guia Valor com fundos destaques em diversas classes, 3º Melhor gestora do ano Guia Fundos FGV.

## 3. Equipe de gestão do fundo

### 3.1 Cite os profissionais envolvidos na gestão

SUGET

Vitor Sodré é o superintendente nacional da área tendo dentro de sua alçada as gerencias GEFIX e GEVAR.

GEFIX

Carlos Biteli é o head de gestão de fundos de renda fixa. Daniel Gracio (líder de equipe), Karen Garrido e Ludmila Sesma são os gestores de portfólio dos fundos atuantes nos mercados de juros e inflação. Mariangela Fraga (líder de equipe), Daniela Sucupira e Leonardo Silva são os gestores de portfólio dos fundos com estratégia preponderante no mercado de crédito privado.

GEVAR

Mauricio Vendruscolo é o head de gestão de fundos de renda variável. Melchior Vinicius dos Santos Felix (líder de equipe), Saulo Moreira da Silva e Rafael Moreira Antonio são os gestores de portfólio dos fundos na mesa de multimercados com preponderância de renda variável. Chrystian Marcell Iamanaka de Faria (líder de equipe), William Dias Calhari e Fabio Renato Leite Colares são os gestores de portfólio dos fundos na mesa de renda variável.

|     |  |
|-----|--|
| 3.2 | Cite o histórico de alterações significativas na equipe nos últimos 05 anos. |
|-----|--|

Todas as movimentações acima ocorreram nos últimos 5 anos

4. Estratégias e carteiras

|     |  |
|-----|--|
| 4.1 | Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o fundo, em cenários de stress. |
|-----|--|

N/A

|     |   |
|-----|---|
| N/A | O fundo pode realizar operações de day trade? |
|-----|---|

Não.

5. Uso de derivativos

|              |  |     |     |
|--------------|--|-----|-----|
| 5.1          | Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:  |     |     |
|              | Proteção de carteira ou de posição   | SIM | NÃO |
|              |  | X   |     |
|              | Mudança de remuneração/indexador   | SIM | NÃO |
|              |  |     | X   |
|              | Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.) | SIM | NÃO |
|              |  |     | X   |
| Alavancagem  | SIM  | NÃO |     |
|              |  | X   |     |
|              |  |     |     |
| 5.2          | Mercados em que são utilizados derivativos:  |     |     |
|              | Juros  | SIM | NÃO |
|              |  |     | X   |
|              | Câmbio   | SIM | NÃO |
|              |  |     | X   |
|              | Ações  | SIM | NÃO |
|              |  | X   |     |
|              | Commodities  | SIM | NÃO |
|              |  |     | X   |
|              | Em Bolsas:   |     |     |
|              | Com garantia   | SIM | NÃO |
|              |  | X   |     |
|              | Sem garantia   | SIM | NÃO |
|              |  |     | X   |
|              | Em Balcão:   |     |     |
|              | Com garantia   | SIM | NÃO |
|              |  | X   |     |
| Sem garantia | SIM  | NÃO |     |
|              |  | X   |     |
|              |  |     |     |
| 5.3          | Qual a abordagem da gestora no investimento em ativos de crédito privado?                              |     |     |
| N/A          |  |     |     |

6. Compra de cotas de fundos de investimento

|     |                         |     |     |
|-----|-------------------------|-----|-----|
| 6.1 | De fundos de terceiros? | SIM | NÃO |
|     |                         |     | X   |
|     |                         |     |     |
| 6.2 | De fundos da gestora?   | SIM | NÃO |
|     |                         | X   |     |

7. Informações adicionais

|      |   |                |
|------|---|----------------|
| 7.1  | PL atual.   | 108.038.659,32 |
| 7.2  | PL médio em 12 (doze) meses.  | 122.502.350,64 |
| 7.3  | PL atual da mesma estratégia sob gestão da gestora.   | 665.281.574,45 |
| 7.4  | Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do fundo e de sua estratégia? Quais são os critérios de definição?  | N/A            |
| 7.5  | Número de cotistas.   | 2911           |
| 7.6  | Qual percentual do passivo do fundo representa aplicações da gestora, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?                                 | N/A            |
| 7.7  | Descreva as regras de concentração de passivo.  | N/A            |
| 7.8  | Percentuais detidos pelos dez maiores cotistas.   | 25,79%         |
| 7.9  | Houve alguma mudança de prestadores de serviços de administração fiduciária e/ou de custódia nos últimos 05 anos da operação do fundo? Quando?  | Não            |
| 7.10 | A última demonstração financeira foi emitida com obteve algum parecer modificado (com ressalva, com abstenção de opinião, ênfase, parecer adverso opinião) pelo auditor independente? | Não            |

8. Gestão de risco

|      |   |   |
|------|---|---|
| 8.1  | Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do fundo.  | Conforme regulamento do Fundo   |
| 8.2  | Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do fundo.  | Conforme regulamento do Fundo   |
| 8.3  | Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.  | Conforme regulamento do Fundo   |
| 8.4  | Se houver na carteira do fundo, ativos/derivativos ilíquidos/exóticos, como a gestora realiza o acompanhamento?   | Conforme regulamento do Fundo   |
| 8.5  | Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, Tracking Error e Expected Shortfall)?   | VaR Paramétrico   |
| 8.6  | Existem limites adicionais àqueles que constam no regulamento/regulação (por ex: concentração por setor, emissor, contraparte, tipo de risco)? Quais?                                   | Conforme Política de Gestão de Riscos disponível no site da instituição           |
| 8.7  | Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 8.5   | Monitoramento do reenquadramento, avaliação do plano de ação e sua implementação. |
| 8.8  | Qual o limite da(s) metodologia(s) citada no item 8.5?  | Limite baseado no nível de risco da carteira proposta pelo regulamento do fundo   |
| 8.9  | De que forma é apurado o consumo dos limites dados pela(s) metodologia(s) citada(s) no item 8.5?  | Acompanhamento diário através de relatórios                                       |
| 8.10 | Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 8.5 foi excedido, por qual motivo e qual o máximo atingido? Comente. |   |

|  |  |                |
|--|--|----------------|
| N/A  |  |                |
| 8.11   | Qual o VaR/B-VaR/TE médio do Fundo nos últimos:  |                |
|  | 3 (três) meses?  | 2.962.469,31   |
|  | 6 (seis) meses?  | 2.576.116,32   |
|  | 12 (doze) meses?   | 2.502.432,42   |
|  | 24 (vinte e quatro) meses?   | 2.812.563,03   |
|  |  |                |
| 8.12   | Qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo fundo e em qual(is) ativo(s) nos últimos 24 (vinte e quatro) meses? |                |
| N/A  |  |                |
| 8.13   | Qual o limite para perdas em cenário de stress? Como são definidos os cenários (ex. Utiliza o cenário elaborado pela B³ ou o próprio)? |                |
| Cenário próprio para monitoramento, sem limite de perda estabelecido |  |                |
| 8.14   | Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite de stress foi excedido e por quê?                        |                |
| N/A  |  |                |
| 8.15   | Qual o stress médio do fundo nos últimos   |                |
|  | 3 (três) meses?  | -23.348.442,96 |
|  | 6 (seis) meses?  | -23.212.908,71 |
|  | 12 (doze) meses?   | -25.843.525,28 |
|  | 24 (vinte e quatro) meses?   | -30.626.611,30 |
|  |  |                |
| 8.16   | Comente o último stop loss relevante do fundo.   |                |
| N/A  |  |                |

9. Comportamento do fundo em crises

| Período*  | Evento                                     | Comportamento<br>(variação do fundo) | Explicação |
|---|--|--------------------------------------|------------|
| mai/06  | Crise das Bolsas norteamericanas           | N/A                                  | N/A        |
| Jul – Ago/07  | Crise das hipotecas                        | N/A                                  | N/A        |
| Out/08 – Mar/09   | Crise no Sistema Financeiro norteamericano | N/A                                  | N/A        |
| Jan/10 – Jun/10   | Crise de endividamento dos PIGS            | N/A                                  | N/A        |
| Abril/11 – Set/11   | Segunda crise da dívida na Europa          | 3.954.861,72                         | VALE5      |
| Abril/15 – Ago/16   | Crise política / recessão no Brasil        | 1.685.091,64                         | XBOV11     |
| * Para o período solicitado deve ser informado o comportamento (variação do fundo) de acordo com o mês fechado (ex. 01/01 a 31/01). |  |                                      |            |

10. Três períodos de maior perda do fundo

|   | Período                   | Evento   | Perda   | Explicação  | Tempo para recuperação |
|---|---------------------------|--|---------|---|------------------------|
| 1 | Entre 10/07/97 e 10/09/98 | Crise Financeira Asiática de 1997 e Crise Financeira Russa de 1998 | -66,82% | Oscilação decorrente da exposição da carteira ao risco de bolsa | 321                    |
| 2 | Entre 20/05/08 e 26/01/16 | Não associado a evento específico                                  | -61,43% | Padrão normal de volatilidade do fundo                          | 978                    |

|   |                           |   |         |   |     |
|---|---------------------------|---|---------|---|-----|
| 3 | Entre 27/03/00 e 16/10/02 | Estouro da Bolha PontoCom em 2000, seguido de Crise Econômica Argentina (2001-2002), Atentado terrorista de 11/09 (2001) e Eleição de Lula (2002) | -55,63% | Oscilação decorrente da exposição da carteira ao risco de bolsa | 283 |
|---|---------------------------|---|---------|---|-----|



## 11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos

|      |   |               |
|------|---|---------------|
| 11.1 | Atribuição:   | Contribuição: |
|      | N/A   | N/A           |
| 11.2 | Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).  |               |
|      | N/A   |               |
| 11.3 | O fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação da gestora, do administrador fiduciário ou órgão regulador? Quando? Por quê? |               |
|      | Sim. Deliberação do administrador. Fechamento em 11/01/2019 e reabertura em 17/01/2019  |               |

## 12. Relacionamento com distribuidores/alocadores

|      |   |
|------|---|
| 12.1 | Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?                           |
|      | Pode ser disponibilizada mensalmente.   |
| 12.2 | Com que frequência é possível realizar conference calls com a gestora dos fundos?   |
|      | A qualquer momento, apenas sujeito a disponibilidade do gestor.   |
| 12.3 | Por quais canais o fundo é distribuído?   |
|      | Rede agências CAIXA, Internet Banking e Mobile.   |
| 12.4 | Considerando o montante total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores distribuidores ou alocadores, individualmente? |
|      | N/A   |

## 13. Atendimento aos cotistas

|      |   |
|------|---|
| 13.1 | Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?  |
|      | Boletim Comercial   Disponibilizado mensalmente, informa a rentabilidade, parâmetros, histórico de rentabilidade e as estratégias permitidas. Defasagem de um mês.<br>Extrato do Fundo   Disponibilizado mensalmente, posição individualizada do cotista. Defasagem de um mês.<br>Relatório de Cota   Disponibilizado diariamente, caso o cotista tenha cadastrado seu endereço eletrônico previamente. informa a variação da cota do fundo. Defasagem de um dia.<br>Relatório da Carteira do Fundo   Disponibilizado mensalmente, dados referente a composição dos ativos do fundo. Defasagem de um mês. |
| 13.2 | Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?  |
|      | Página da internet e o conteúdo é atualizado sempre que necessário.   |
| 13.3 | Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?  |
|      | A Rede de agências CAIXA, principal canal de atendimento ao cotista. O atendimento conta ainda com a GERDI, como unidade de suporte a fundos junto à rede.  |

14. Investimento no exterior

|      |  |  |
|------|--|--|
| 14.1 | Qual o produto (tipo de ativo ou fundo investido) e sua estrutura, incluindo os veículos utilizados (se houver)?<br>Descreva a estratégia, os principais ativos e instrumentos utilizados.   |  |
| 14.2 | Quais os riscos envolvidos?  |  |
| 14.3 | Quais são os mercados em que o fundo opera?  |  |
| 14.4 | Em relação ao veículo local, o fundo utiliza estratégias para proteção cambial?  |  |
| 14.5 | Caso o fundo de investimento local tenha por objetivo o investimento em único fundo de investimento ou veículo no exterior (fundo espelho), enumerar os prestadores de serviços e demais informações dos fundo de investimento ou veículo no exterior (administrador, custodiante, RTA, prime broker, entre outros). |  |
|      | Administrador Fiduciário   |  |
|      | Custodiante  |  |
|      | Auditor  |  |
|      | RTA  |  |
|      | Prime Brokers  |  |
|      | NAV Calculator   |  |
|      | Domicílio do fundo   |  |
|      | Taxa de administração  |  |
|      | Código ISIN do fundo   |  |
|      | Moeda do domicilio fundo no exterior   |  |
|      | Outros prestadores de serviço, dos investimentos no exterior, caso exista.   |  |
| 14.6 | Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.   |  |
| 14.7 | Caso a gestora tenha influência direta/indireta na gestão do fundo no exterior, descreva como foi constituída a diretoria do fundo.  |  |

15. Anexos (quando aplicável)

| 15   | Anexos (quando aplicável)                        | Marcar Anexos ou link para acesso ao documento |
|------|--|--|
| 15.1 | Regulamento                                      | <a href="#">Link de acesso</a>                 |
| 15.2 | Formulário de informações complementares         | <a href="#">Link de acesso</a>                 |
| 15.3 | Última lâmina de informações essenciais          | <a href="#">Link de acesso</a>                 |
| 15.4 | Relatório de Gestão e/ou materiais de divulgação | <a href="#">Link de acesso</a>                 |

[ASSINATURA DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O  
QUESTIONÁRIO]

[NOME DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO]

[CARGO]  
[TELEFONE]  
[E-MAIL CORPORATIVO]

[ASSINATURA DO(S) REPRESENTANTE(S)  
LEGAL(IS) DA  
INSTITUIÇÃO]

[NOME DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA  
INSTITUIÇÃO]

[CARGO]  
[TELEFONE]  
[E-MAIL CORPORATIVO]