

ANEXO I – FUNDOS DE INVESTIMENTO

1. Alterações desde a última atualização

1.1	Nome do fundo	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO		
1.2	CNPJ	
15.154.220/0001-47		
1.3	Data de início	
01/11/2012		
1.4	Classificação ANBIMA	
Ações Small Caps		
1.5	Código ANBIMA	
317594		
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)	
0238-050-00001837/7		
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	
1,50%		
1.21	Taxa de administração máxima	
1,50%		
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.
Aplica seus recursos em carteira composta por ativos de empresas de menor capitalização no mercado, baseando-se em cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.	
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 EXCELENTEs 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.	569.834.602,44
7.2	PL médio em 12 (doze) meses.	716.983.896,92
7.3	PL atual da mesma estratégia sob gestão da gestora.	569.834.597,43
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.	6919
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.	38,77%
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?	19.477.707,33
	6 (seis) meses?	18.033.789,16
	12 (doze) meses?	20.274.529,10
	24 (vinte e quatro) meses?	23.328.839,45
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?	-125.252.093,54
	6 (seis) meses?	-126.797.490,34
	12 (doze) meses?	-148.268.088,40
	24 (vinte e quatro) meses?	-204.010.236,67
8.16	Comente o último stop loss relevante do fundo.	
N/A		

9. Comportamento do fundo em crises

Período*	Evento	Comportamento (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	N/A	N/A
Abril/15 – Ago/16	Crise política / recessão no Brasil	187.517,75	VLID3
* 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 23/01/20 e 23/03/20	Pandemia Covid-19	-51,86%	Oscilação decorrente da exposição da carteira ao risco de bolsa	
2	Entre 21/06/21 e 01/03/23	Não associado a evento específico	-43,58%	Padrão normal de volatilidade do fundo	

3	Entre 01/02/13 e 20/01/16	Não associado a evento específico	-43,19%	Padrão normal de volatilidade do fundo	385
---	---------------------------	-----------------------------------	---------	----------------------------------------	-----



## 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 31/01/2018 e reabertura em 19/06/2018	

## 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. Extrato do Fundo   Disponibilizado mensalmente, posição individualizada do cotista. Defasagem de um mês. 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. 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)? 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]