

CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP

42.229.068/0001-97

Resumo

Gestão: Caixa DTVM

Auditoria: KPMG

Administrador: Caixa Econômica Federal

Início: 04/07/2022

Custodiante: Caixa Econômica Federal

Resolução: Artigo 10º, Inciso I

Taxas

Taxa de Administração: 0,90%

Índice de Performance: Não possui

Taxa de Performance:

Taxa de Resgate:

Carência: 806 dias

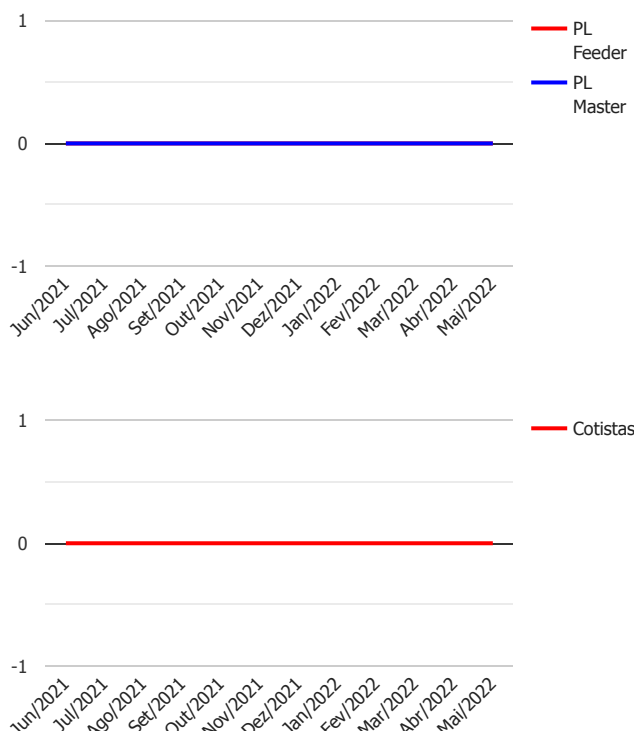
Benchmark: Não definido

Público Alvo: Investidores em geral

Investidor Qualificado: Não

Evolução PL e Cotistas

MÊS	Fundo Feeder		Fundo Master
	COTISTA	PL FEEDER	PL MASTER
Jun/2021			
Jul/2021			
Ago/2021			
Set/2021			
Out/2021			
Nov/2021			
Dez/2021			
Jan/2022			
Fev/2022			
Mar/2022			
Abr/2022			
Mai/2022			



CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP

42.229.068/0001-97

### Informações Operacionais

Depósito Inicial:

Conversão de Cota para Aplicação:

Movimentação Mínima:

Conversão de Cota para Resgate: D+0

Disponibilidade dos Recursos Aplicados:

Disponibilidade dos Recursos Resgatados: D+2

### Histórico

Máximo Retorno Diário: em

Retorno acumulado desde o início:

Número de dias com Retorno Positivo:

Número de dias com retorno negativo:

Mínimo Retorno Diário: em

Volatilidade desde o início:

### Performance comparativa - Valores em ( % )

FUNDO E BENCHMARK'S	MÊS	ANO	3M	6M	12M	24M	VaR
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP	-	-	-	-	-	-	-
ÍNDICE DE REFERÊNCIA (Não definido)	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 5,25% A.A. (META ATUARIAL)	0,85	7,91	3,26	7,91	17,47	33,93	2,79

O fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
---	-----

CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP

42.229.068/0001-97

#### Comentário sobre os fundamentos do fundo

##### **Política de investimento:**

O objetivo do fundo é buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos preponderantemente em cotas do Fundo de Investimento **CAIXA Master Capital Protegido Cesta Agro Multimercado Longo Prazo, CNPJ: 41.733.441/0001-80**, durante a vigência da estratégia de investimento ("Operação Estruturada"), e, findo os prazos, buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas de Fundos de Investimento que apliquem em Títulos Públicos Federais, não constituindo tal objetivo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da administradora.

##### **Objetivo:**

O objetivo do FUNDO é obter rentabilidade, com a proteção do capital investido, durante a vigência da "Operação Estruturada", e, findo os prazos, proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da administradora.

Os retornos esperados para a "Operação Estruturada", o IPCA Projetado para o Prazo da "Operação Estruturada", Taxa prefixada de alta e Barreira de alta serão conhecidos na data do início do Prazo da "Operação Estruturada" do fundo e serão divulgados posteriormente aos Cotistas na página da administradora.

O fundo possui barreira de alta de 103% | O IPCA projetado é 10,32% a.p. | A taxa prefixada de alta é 20% a.p.

A Operação terá início em **19/07/2022** e **término em 01/10/2024** (Período da "Operação Estruturada").

##### **Composição da carteira:**

O fundo possuirá quatro ações na carteira: MRFG3; JBSS3; CSAN3 e KLBN11.

##### **Cenário 01:**

Se não houver nenhum rompimento das barreiras e as ações forem positivas: capital investido + variação das ações OU IPCA projetado (o que for maior).

##### **Cenário 02:**

Se não houver rompimento de nenhuma barreira durante o período e as ações forem negativas: capital investido + IPCA projetado.

##### **Cenário 03:**

Se houver rompimento das barreiras durante o período, indefere o resultado das ações: capital investido + IPCA projetado + taxa prefixada de alta.

##### **Taxa de Administração:**

O total da taxa de administração do FUNDO é de 0,90% ao ano e está em linha com as práticas adotadas pelo mercado para fundos com estratégias semelhantes.

##### **Risco:**

O fundo incorre dos Riscos de Concentração, Liquidez, Crédito e Mercado.

##### **Enquadramento:**

O regulamento do fundo analisado (v. **04/07/2022**), está devidamente enquadrado quanto ao disposto no **Artigo 10º, Inciso I da resolução CMN nº 4.963/21**, não havendo, portanto, impedimento legal para recebimento de aportes por parte do RPPS.

CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP

42.229.068/0001-97

**Rentabilidade**

	Retorno Efetivo					Retorno Efetivo			
	Mês	Ano	6 Meses	1 Ano	2 Anos	Retorno Acumulado	Volatilidade	Sharpe	Taxa Administração
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP									0,90
Não definido									

	ANO	ACU
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP		
Não definido		

Enquadramento do fundo pela resolução 4.963 - Estratégia de alocação - Limite 2022

Artigo	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Inferior %	Alvo %	Superior %	GAP Superior \$
Artigo 10º, Inciso I	10,00	9.096.391,84	3,77	0,00	4,00	10,00	15.052.458,32

Dado o PL do FUNDO MASTER (base fevereiro /2021) e o possível investimento do RPPS, há suporte de até R\$ 0,00 para novos investimentos no FUNDO.

CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO FIC MULTIMERCADO LP

42.229.068/0001-97

#### Avaliação do fundo dentro do contexto da carteira do RPPS de IJUÍ

A política de investimentos do RPPS elaborada para o exercício de 2022 permite alocação máxima no limite superior de até 10,00 % em fundos enquadrados no **Artigo 10º, Inciso I da resolução CMN nº 4.963/21**. Atualmente, a carteira apresenta 3,77 % (base 05/2022), havendo margem para novos investimentos até o limite superior de R\$ 15.052.458,32.

Atualmente, o RPPS não tem investimentos neste fundo, possuindo aproximadamente 0,00 % da carteira em fundos com estratégias semelhantes.

Diante da análise dos fundamentos do fundo e do contexto do mesmo na carteira do RPPS, sugerimos o aporte no fundo, e caso o RPPS opte pelo investimento, recomendamos que os recursos sejam resgatados do segmento IMA-B ou IRF-M.

A administradora/gestora cumpre os requisitos exigidos na lista exaustiva das instituições que atendem as novas condições estabelecidas na Resolução CMN nº 4695 de novembro de 2018, disposto no Artigo 15, § 2º, Inciso I, portanto, o fundo está apto para receber aportes do RPPS.

Na opção de realizar o investimento, o administrador e gestor do fundo deverão estar credenciados, em obediência aos requisitos da Resolução CMN nº 4.963/2021, Artigo 19º, e Portaria MPS 519/2011 e alterações, considerados aptos pelo órgão colegiado competente do RPPS.

Rio Negrinho, 08 de julho de 2022



Mosaico Consultoria

## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Na opção de realizar o investimento, o administrador e gestor do fundo deverão estar credenciados, em obediência aos requisitos da Resolução CMN nº 4.963/21, Artigo 1º, § 1º, Inciso VI, e § 3º, Portaria MPS 519/2011 e alterações, considerados aptos pelo órgão colegiado competente do RPPS.

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.