

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º trimestre e ano de 2019

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

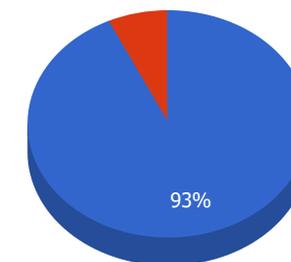
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.312.706,21	14,36%	949	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.337.518,46	14,63%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.423.575,58	15,57%	923	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.221.406,40	13,36%	964	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.673.194,72	18,30%	695	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	357.887,97	3,91%	376	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	486.236,69	5,32%	688	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	680.974,71	7,45%	324	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	7.101,84	0,08%	15.497	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	643.443,75	7,04%	4.665	0,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			9.144.046,33				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			208.285,66				Artigo 6º
PL Total			9.352.331,99				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	9.144.046,33
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	6.968.401,37	76,21%	50,00%	60,00%	100,00%	2.175.644,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	9.144.046,33
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	457.202,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	5.486.427,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	5.486.427,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.532.201,21	16,76%	0,00%	20,00%	40,00%	2.125.417,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	3.657.618,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.828.809,27
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	1.371.606,95
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.371.606,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	457.202,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	457.202,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	457.202,32
Total Renda Fixa	100,00%	8.500.602,58	92,96%	50,00%	90,00%	570,00%	

Distribuição por Segmento

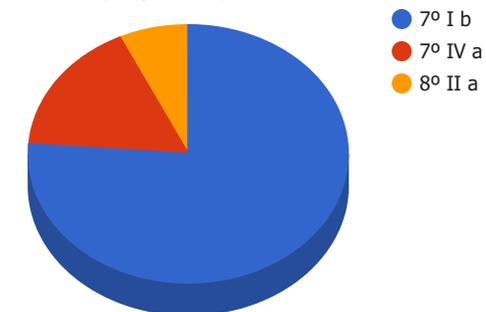


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	2.743.213,90
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	2.743.213,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	643.443,75	7,04%	0,00%	5,00%	20,00%	1.185.365,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.828.809,27
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	914.404,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	457.202,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	457.202,32
Total Renda Variável	30,00%	643.443,75	7,04%	0,00%	10,00%	120,00%	

Distribuição por Artigos



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.144.046,33	100,00	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	6.968.401,37	76,21	50,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.532.201,21	16,76	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	643.443,75	7,04	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	11,19%	2,40%	4,92%	11,19%	21,53%	0,01%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,55%	1,33%	3,22%	6,55%	13,80%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,21%	12,85%	2,52%	5,31%	12,85%	23,77%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,99%	22,59%	2,70%	6,52%	22,59%	38,33%	0,03%	0,07%
CDI (Benchmark)	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,35%	5,72%	1,11%	2,62%	5,72%	12,30%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,31%	5,07%	1,03%	2,36%	5,07%	10,90%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,59%	16,43%	1,80%	4,97%	16,43%	25,53%	0,01%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	5,91%	1,20%	2,76%	5,91%	12,45%	0,00%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05%	0,98%	0,18%	0,40%	0,98%	2,25%	0,00%	0,00%

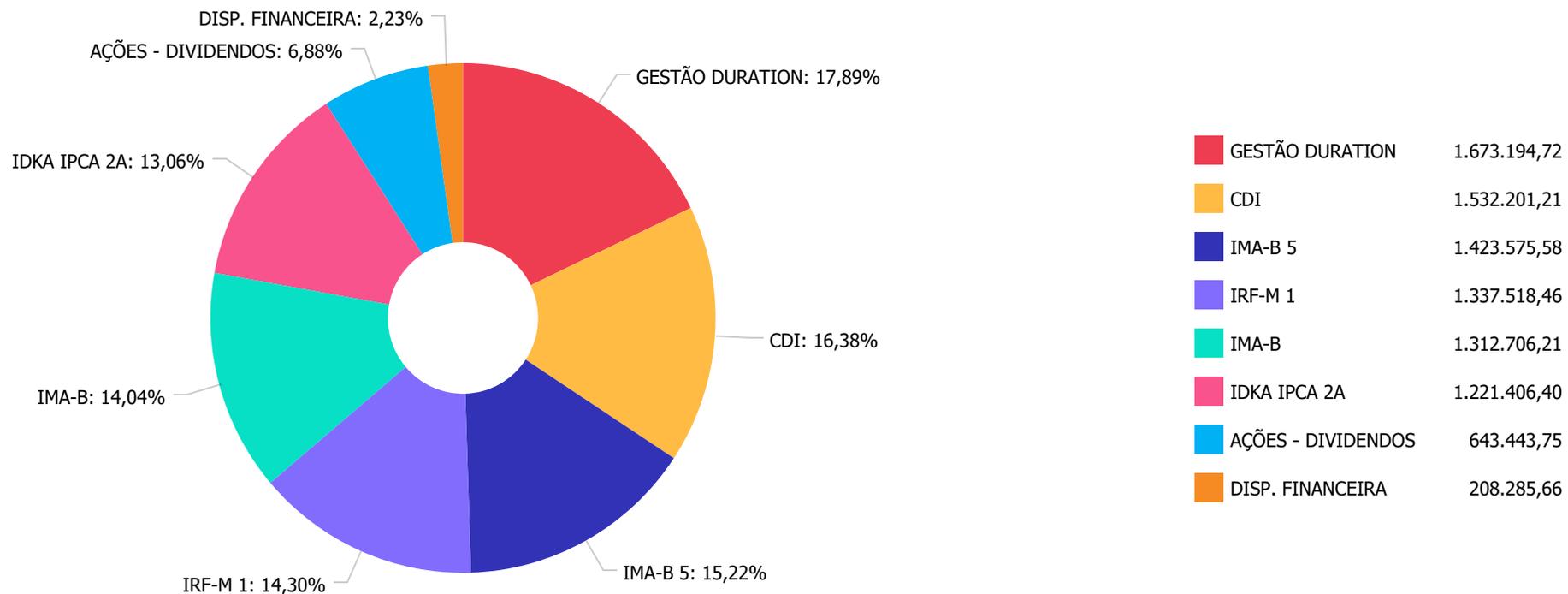
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	12,21%	41,75%	18,02%	24,77%	41,75%	54,70%	0,05%	0,17%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2019)



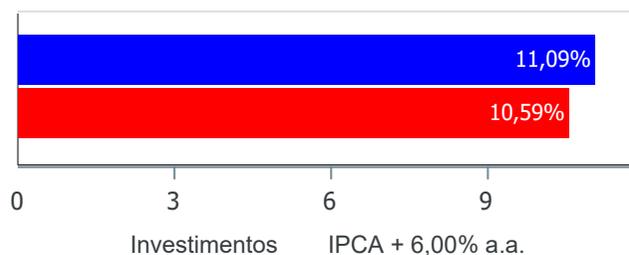
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	6.492.755,34	2.690.305,87	2.267.737,21	6.977.949,50	62.625,50	62.625,50	0,91%	0,91%	0,83%	0,83%	108,90%	0,31%
Fevereiro	6.977.949,50	672.363,47	475.764,86	7.206.005,56	31.457,45	94.082,95	0,44%	1,35%	0,90%	1,73%	77,71%	0,55%
Março	7.206.005,56	169.117,58	303.745,85	7.103.449,07	32.071,78	126.154,73	0,45%	1,80%	1,19%	2,95%	61,01%	0,97%
Abril	7.103.449,07	966.335,24	218.578,82	7.897.213,33	46.007,84	172.162,57	0,59%	2,40%	1,06%	4,04%	59,30%	0,35%
Mai	7.897.213,33	3.508.453,36	4.528.619,53	6.958.679,05	81.631,89	253.794,46	1,03%	3,45%	0,64%	4,71%	73,39%	0,91%
Junho	6.958.679,05	1.446.121,51	313.243,47	8.231.406,31	139.849,22	393.643,68	1,73%	5,24%	0,45%	5,18%	101,24%	1,31%
Julho	8.231.406,31	546.929,47	1.031.955,91	7.832.000,05	85.620,18	479.263,86	1,04%	6,34%	0,72%	5,94%	106,69%	0,96%
Agosto	7.832.000,05	865.796,21	681.607,94	8.024.725,42	8.537,10	487.800,96	0,11%	6,45%	0,62%	6,60%	97,77%	1,74%
Setembro	8.024.725,42	380.202,66	316.919,68	8.217.177,82	129.169,42	616.970,38	1,60%	8,15%	0,45%	7,07%	115,23%	1,26%
Outubro	8.217.177,82	1.560.372,01	1.011.834,72	8.894.613,87	128.898,76	745.869,14	1,47%	9,74%	0,63%	7,75%	125,66%	1,23%
Novembro	8.894.613,87	1.016.698,31	960.204,02	8.931.741,69	-19.366,47	726.502,67	-0,22%	9,50%	0,98%	8,80%	107,95%	0,95%
Dezembro	8.931.741,69	2.079.455,42	1.998.070,13	9.144.046,33	130.919,35	857.422,02	1,45%	11,09%	1,64%	10,59%	104,76%	1,17%

Investimentos x Meta Atuarial



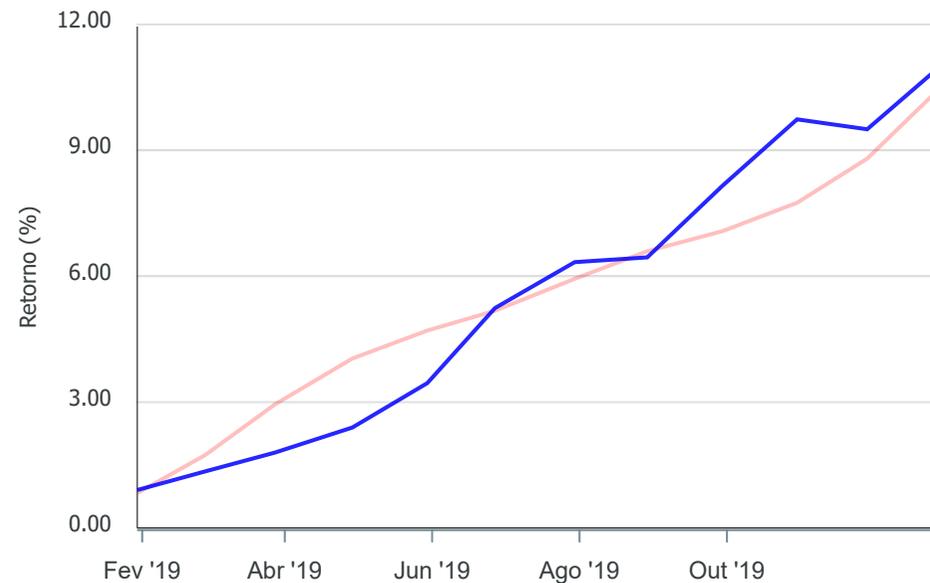
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.208.121,98	0,00	0,00	1.221.406,40	13.284,42	1,10%	1,10%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.296.189,48	500.000,00	500.000,00	1.312.706,21	16.516,73	0,92%	1,99%	2,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.411.186,21	600.000,00	600.000,00	1.423.575,58	12.389,37	0,62%	1,21%	1,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.663.324,66	0,00	0,00	1.673.194,72	9.870,06	0,59%	0,59%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.332.157,70	0,00	0,00	1.337.518,46	5.360,76	0,40%	0,40%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	356.548,19	0,00	0,00	357.887,97	1.339,78	0,38%	0,38%	0,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	484.531,83	0,00	0,00	486.236,69	1.704,86	0,35%	0,35%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	605.817,57	748.545,00	673.793,32	680.974,71	405,46	0,03%	0,31%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	451,46	230.910,42	224.276,81	7.101,84	16,77	0,01%	0,05%	0,01%
Total Renda Fixa	8.358.329,08	2.079.455,42	1.998.070,13	8.500.602,58	60.888,21	0,72%		0,91%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	573.412,61	0,00	0,00	643.443,75	70.031,14	12,21%	12,21%	4,65%
Total Renda Variável	573.412,61	0,00	0,00	643.443,75	70.031,14	12,21%		4,65%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.393.119,41	600.000,00	600.000,00	1.423.575,58	30.456,17	1,53%	2,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.643.656,38	0,00	0,00	1.673.194,72	29.538,34	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.192.770,09	0,00	0,00	1.221.406,40	28.636,31	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.287.221,52	500.000,00	500.000,00	1.312.706,21	25.484,69	1,43%	2,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.208.597,30	111.714,47	0,00	1.337.518,46	17.206,69	1,30%	1,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	480.881,49	0,00	0,00	486.236,69	5.355,20	1,11%	1,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	353.630,42	0,00	0,00	357.887,97	4.257,55	1,20%	1,20%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	102.452,67	2.872.138,29	2.294.872,93	680.974,71	1.256,68	0,04%	1,03%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	9.636,19	572.672,98	575.235,94	7.101,84	28,61	0,00%	0,18%
				Total Renda Fixa	142.220,24	1,70%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	545.212,35	0,00	0,00	643.443,75	98.231,40	18,02%	18,02%
				Total Renda Variável	98.231,40	18,02%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.221.395,19	520.193,49	300.000,00	1.673.194,72	231.606,04	13,30%	16,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.465.818,21	916.712,23	4.207.000,00	1.337.518,46	161.988,02	3,01%	6,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.703.676,75	500.000,00	1.312.706,21	109.029,46	6,40%	22,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	1.933.589,22	600.000,00	1.423.575,58	89.986,36	4,65%	12,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	1.174.825,14	24.698,17	1.221.406,40	71.279,43	6,07%	11,19%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	459.949,54	0,00	0,00	486.236,69	26.287,15	5,72%	5,72%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	337.906,39	0,00	0,00	357.887,97	19.981,58	5,91%	5,91%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	5.137.401,50	4.459.549,91	680.974,71	3.123,12	0,06%	5,07%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.686,01	4.015.752,78	4.017.034,06	7.101,84	697,11	0,02%	0,98%
				Total Renda Fixa	713.978,27	9,17%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	643.443,75	143.443,75	28,69%	41,75%
				Total Renda Variável	143.443,75	28,69%	