

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2020

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 (Fevereiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.234.369,91	14,14%	968	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.321.720,10	15,15%	941	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.348.049,57	15,45%	1.359	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.440.332,04	16,50%	922	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.906.596,82	21,85%	731	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	13.670,83	0,16%	15.895	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	360.320,55	4,13%	392	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	489.376,33	5,61%	684	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.724,38	0,16%	321	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	598.484,37	6,86%	7.024	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			8.726.644,90				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			298.765,19				Artigo 6º
PL Total			9.025.410,09				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠️ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2020** não está cadastrada !!!

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Fevereiro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.726.644,90	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,69%	1,22%	2,44%	5,37%	11,19%	22,52%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,60%	1,06%	2,17%	4,96%	10,35%	20,98%	0,01%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,38%	0,82%	1,25%	2,87%	6,52%	13,85%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,36%	0,79%	1,19%	2,77%	6,31%	13,44%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,64%	1,20%	2,45%	5,66%	12,17%	23,49%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,18%	2,40%	5,51%	11,87%	22,95%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,45%	0,71%	2,73%	6,54%	18,00%	34,65%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,44%	0,69%	2,69%	6,35%	17,63%	34,00%	0,02%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27%	0,65%	1,00%	2,22%	5,33%	11,90%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,23%	0,53%	0,84%	1,97%	4,70%	10,48%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,62%	1,44%	2,04%	5,45%	14,23%	25,27%	0,01%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,29%	0,68%	1,06%	2,39%	5,57%	12,08%	0,00%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,05%	0,10%	0,27%	0,83%	2,05%	0,00%	0,00%

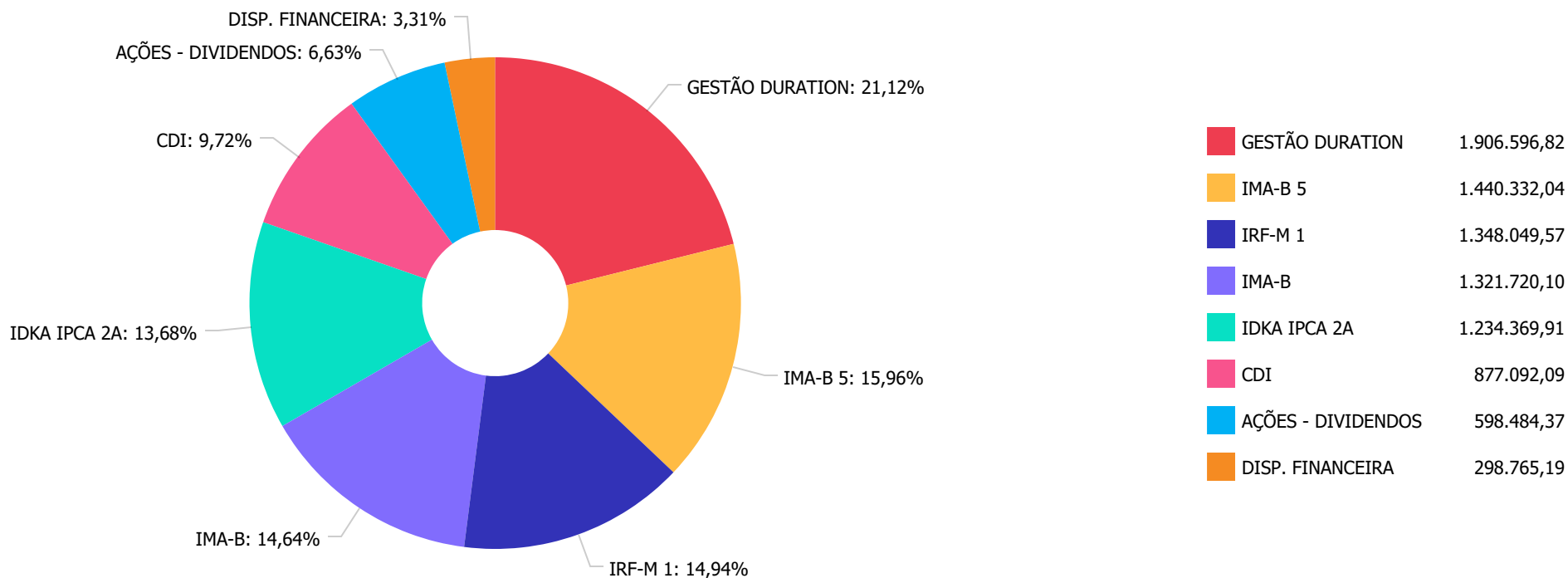
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-8,37%	-6,99%	4,37%	11,31%	20,06%	36,50%	0,16%	0,16%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2020)



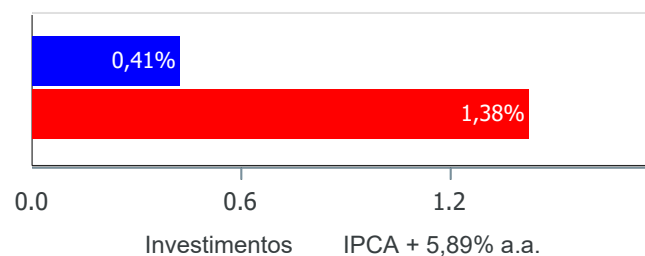
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	9.144.046,33	433.504,50	744.032,41	8.884.516,53	50.998,11	50.998,11	0,56%	0,56%	0,71%	0,71%	78,34%	1,24%
Fevereiro	8.884.516,53	1.685.687,83	1.830.442,47	8.726.644,90	-13.116,99	37.881,12	-0,15%	0,41%	0,66%	1,38%	29,71%	1,93%

Investimentos x Meta Atuarial



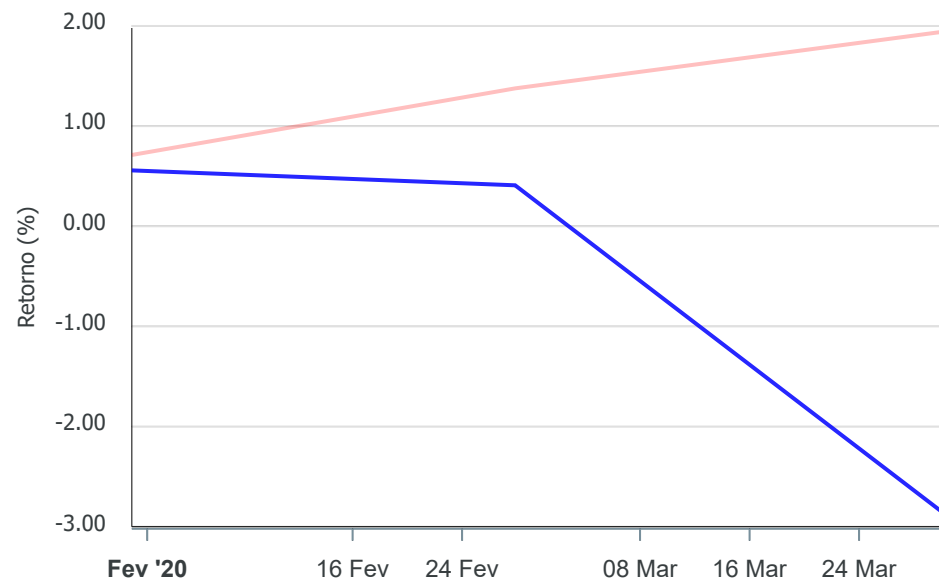
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Fevereiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.431.321,28	0,00	0,00	1.440.332,04	9.010,76	0,63%	0,63%	0,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.894.903,43	0,00	0,00	1.906.596,82	11.693,39	0,62%	0,62%	0,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.226.990,10	0,00	0,00	1.234.369,91	7.379,81	0,60%	0,60%	0,69%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.315.944,15	0,00	0,00	1.321.720,10	5.775,95	0,44%	0,44%	2,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.343.170,46	0,00	0,00	1.348.049,57	4.879,11	0,36%	0,36%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	359.270,58	0,00	0,00	360.320,55	1.049,97	0,29%	0,29%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	488.039,69	0,00	0,00	489.376,33	1.336,64	0,27%	0,27%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	164.655,27	1.662.898,94	1.814.223,02	13.724,38	393,19	0,02%	0,23%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.100,65	22.788,89	16.219,45	13.670,83	0,74	0,00%	0,01%	0,00%
Total Renda Fixa	8.231.395,61	1.685.687,83	1.830.442,47	8.128.160,53	41.519,56	0,42%		0,88%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	653.120,92	0,00	0,00	598.484,37	-54.636,55	-8,37%	-8,37%	16,17%
Total Renda Variável	653.120,92	0,00	0,00	598.484,37	-54.636,55	-8,37%		16,17%