

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019

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

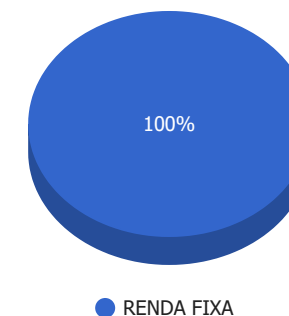
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.586.714,18	65,73%	1.466	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.256.582,48	18,01%	362	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	339.689,17	4,87%	424	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	462.382,44	6,63%	823	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	332.581,23	4,77%	15.529	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			6.977.949,50				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			158.514,89				Artigo 6º
PL Total			7.136.464,39				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 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%	6.977.949,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.586.714,18	65,73%	50,00%	60,00%	100,00%	2.391.235,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	6.977.949,50
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	348.897,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.186.769,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.186.769,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.134.652,84	16,26%	0,00%	20,00%	40,00%	1.656.526,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.791.179,80
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.395.589,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	1.046.692,43
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.046.692,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	348.897,48
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	348.897,48
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	348.897,48
Total Renda Fixa	100,00%	5.721.367,02	81,99%	50,00%	90,00%	570,00%	

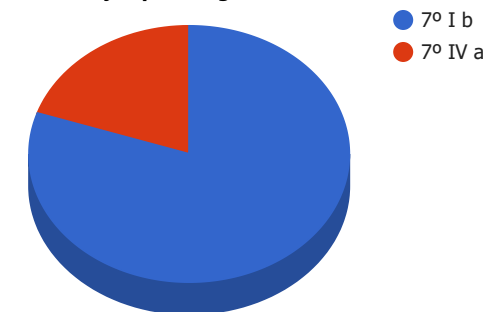
Distribuição por Segmento



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 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%	2.093.384,85
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	2.093.384,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	1.395.589,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.395.589,90
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	697.794,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	348.897,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	348.897,48
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	120,00%	

Distribuição por Artigos



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.977.949,50	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 '	4.586.714,18	65,73	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 '	2.391.235,32	34,27	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 '	0,00	0,00	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

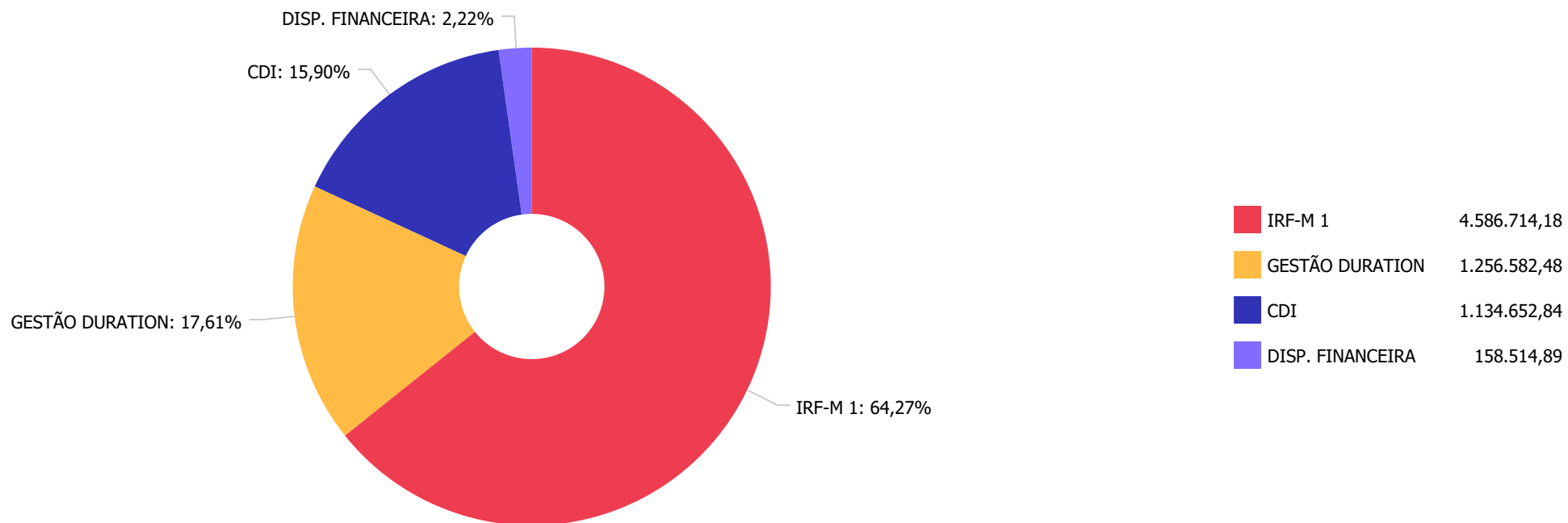
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,65%	3,62%	6,80%	17,67%	0,00%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	0,53%	1,50%	3,07%	6,19%	16,16%	0,00%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	0,53%	1,49%	3,04%	6,13%	16,04%	0,00%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,10%	0,10%	0,29%	0,59%	1,22%	5,40%	0,00%	0,00%

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



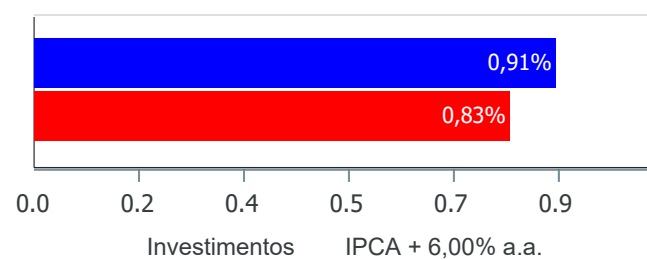
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2019)



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%

Investimentos x Meta Atuarial



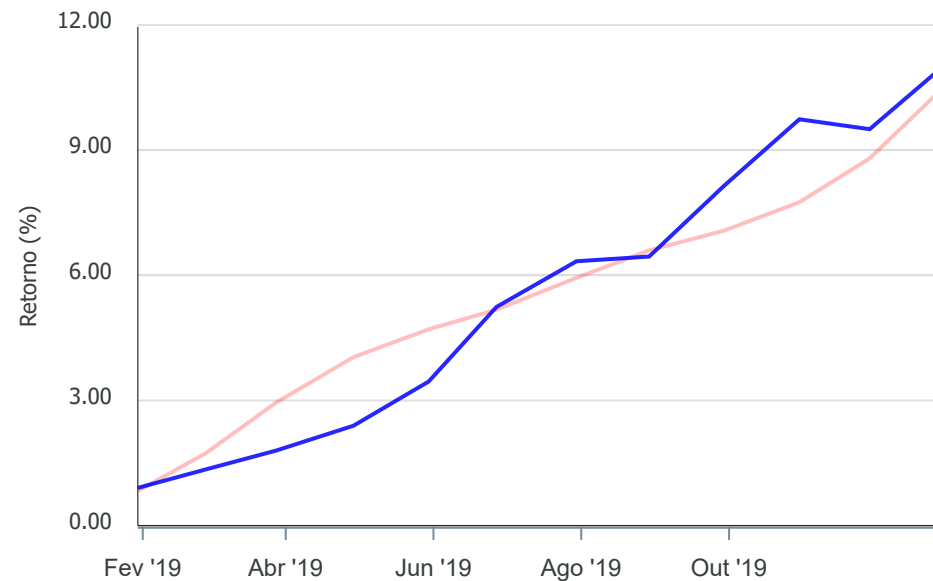
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.221.395,19	0,00	0,00	1.256.582,48	35.187,29	2,88%	2,88%	1,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	459.949,54	0,00	0,00	462.382,44	2.432,90	0,53%	0,53%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	337.906,39	0,00	0,00	339.689,17	1.782,78	0,53%	0,53%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.465.818,21	804.997,76	707.000,00	4.586.714,18	22.898,21	0,43%	0,57%	0,10%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.686,01	1.885.308,11	1.560.737,21	332.581,23	324,32	0,02%	0,10%	0,00%
Total Renda Fixa	6.492.755,34	2.690.305,87	2.267.737,21	6.977.949,50	62.625,50	0,91%		0,31%