

# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2020

**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 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	1.226.990,10	13,81%	969	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.315.944,15	14,81%	941	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.343.170,46	15,12%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.431.321,28	16,11%	922	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.894.903,43	21,33%	717	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	7.100,65	0,08%	15.813	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	359.270,58	4,04%	383	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	488.039,69	5,49%	684	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	164.655,27	1,85%	324	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	653.120,92	7,35%	6.358	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>8.884.516,53</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>35.412,68</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>8.919.929,21</b>				

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

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

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.884.516,53	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 Janeiro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	0,46%	1,57%	4,44%	10,30%	20,93%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	0,42%	1,14%	2,93%	6,40%	13,64%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,54%	1,41%	4,89%	11,76%	22,83%	0,01%	0,02%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,25%	0,25%	-0,36%	5,44%	17,72%	34,14%	0,02%	0,06%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37%	0,37%	1,03%	2,44%	5,55%	12,08%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,30%	0,30%	0,92%	2,17%	4,90%	10,67%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	0,39%	1,09%	2,59%	5,76%	12,25%	0,00%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,03%	0,03%	0,15%	0,32%	0,91%	2,14%	0,00%	0,00%

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

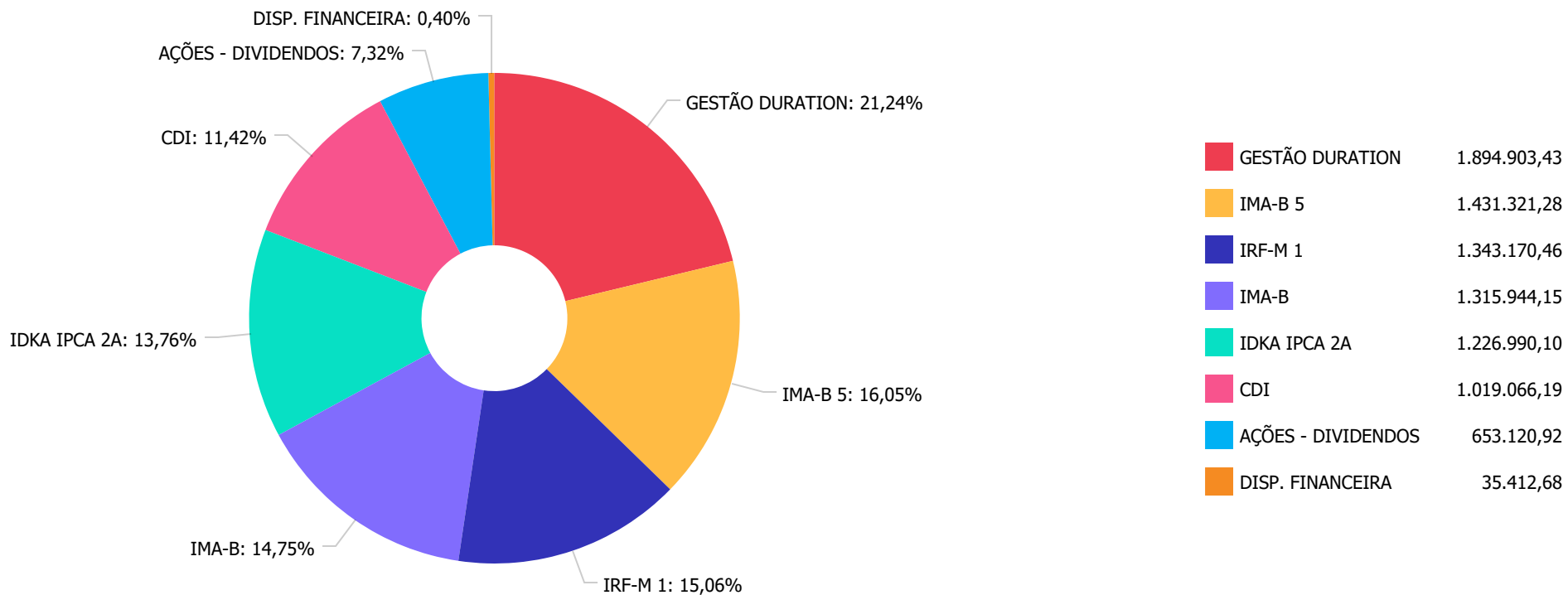
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,50%	1,50%	18,04%	22,35%	26,94%	49,81%	0,09%	0,13%



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



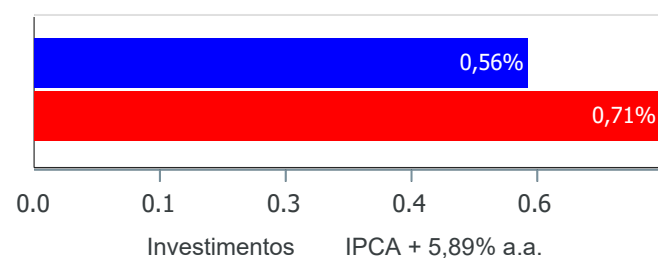
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2020)



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%

Investimentos x Meta Atuarial



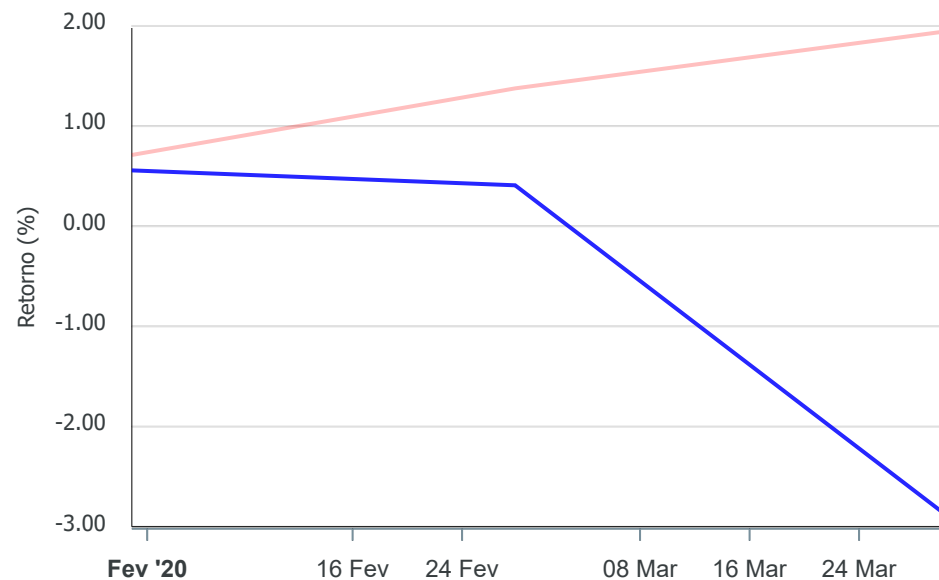
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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/2020

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	1.673.194,72	206.331,13	0,00	1.894.903,43	15.377,58	0,82%	0,82%	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.423.575,58	0,00	0,00	1.431.321,28	7.745,70	0,54%	0,54%	0,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.221.406,40	0,00	0,00	1.226.990,10	5.583,70	0,46%	0,46%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.337.518,46	0,00	0,00	1.343.170,46	5.652,00	0,42%	0,42%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	357.887,97	0,00	0,00	359.270,58	1.382,61	0,39%	0,39%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	486.236,69	0,00	0,00	488.039,69	1.803,00	0,37%	0,37%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.312.706,21	0,00	0,00	1.315.944,15	3.237,94	0,25%	0,25%	1,67%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	680.974,71	201.103,83	717.958,62	164.655,27	535,35	0,06%	0,30%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.101,84	26.069,54	26.073,79	7.100,65	3,06	0,01%	0,03%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>8.500.602,58</b>	<b>433.504,50</b>	<b>744.032,41</b>	<b>8.231.395,61</b>	<b>41.320,94</b>	<b>0,46%</b>		<b>0,62%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	643.443,75	0,00	0,00	653.120,92	9.677,17	1,50%	1,50%	8,96%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>643.443,75</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>653.120,92</b>	<b>9.677,17</b>	<b>1,50%</b>		<b>8,96%</b>