

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2019

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

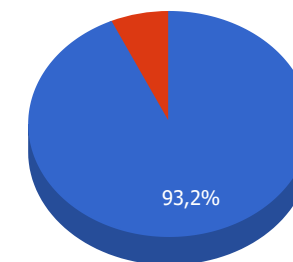
Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2019)

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	1.154.979,97	14,75%	956	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.194.797,22	15,26%	1.391	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.369.083,24	17,48%	902	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.174.843,23	15,00%	937	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.505.800,00	19,23%	600	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	530,65	0,01%	15.866	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	350.200,65	4,47%	403	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	71.553,02	0,91%	326	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	476.411,46	6,08%	784	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	533.800,61	6,82%	1.886	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			7.832.000,05				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			132,95				Artigo 6º
PL Total			7.832.133,00				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 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%	7.832.000,05
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	6.399.503,66	81,71%	50,00%	60,00%	100,00%	1.432.496,39
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	7.832.000,05
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	391.600,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.699.200,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.699.200,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	898.695,78	11,47%	0,00%	20,00%	40,00%	2.234.104,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	3.132.800,02
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.566.400,01
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	1.174.800,01
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.174.800,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	391.600,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	391.600,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	391.600,00
Total Renda Fixa	100,00%	7.298.199,44	93,18%	50,00%	90,00%	570,00%	

Distribuição por Segmento

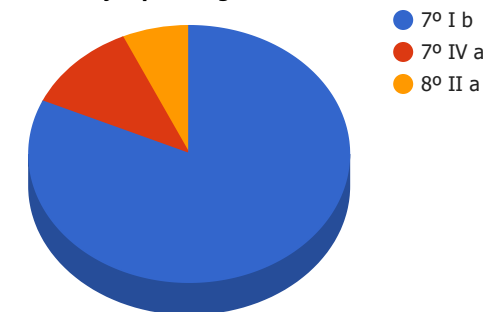


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 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%	2.349.600,02
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	2.349.600,02
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	533.800,61	6,82%	0,00%	5,00%	20,00%	1.032.599,40
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.566.400,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	783.200,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	391.600,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	391.600,00
Total Renda Variável	30,00%	533.800,61	6,82%	0,00%	10,00%	120,00%	

Distribuição por Artigos



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	6,95%	3,23%	5,61%	11,87%	21,28%	0,01%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	3,95%	1,94%	3,37%	7,11%	14,84%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,18%	4,07%	6,55%	13,88%	23,03%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	16,55%	8,83%	11,64%	27,24%	35,12%	0,01%	0,08%
CDI (Benchmark)	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	3,58%	1,55%	3,03%	6,19%	13,55%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,49%	3,15%	1,37%	2,67%	5,46%	12,01%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	12,15%	6,69%	9,01%	16,92%	25,04%	0,01%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	3,64%	1,62%	3,09%	6,23%	13,60%	0,00%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,11%	0,69%	0,30%	0,58%	1,18%	3,11%	0,00%	0,00%

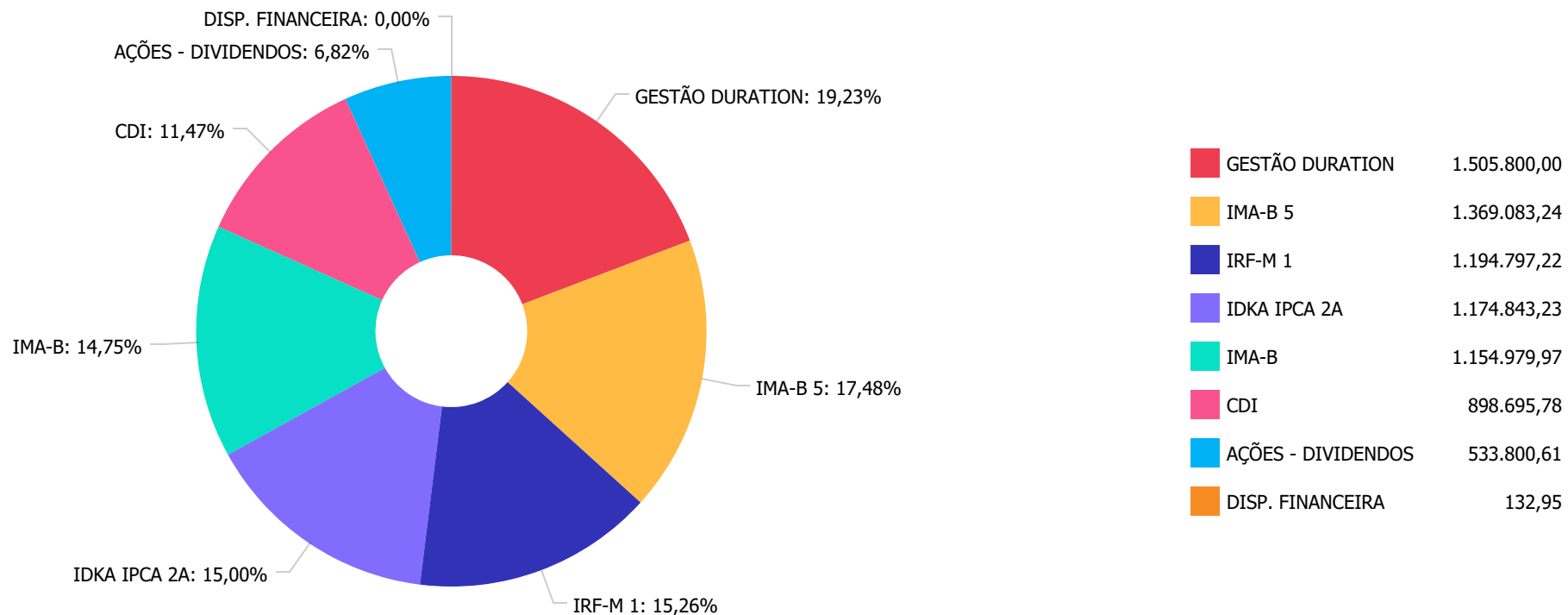
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,51%	17,60%	8,37%	3,75%	37,57%	42,67%	0,05%	0,18%

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



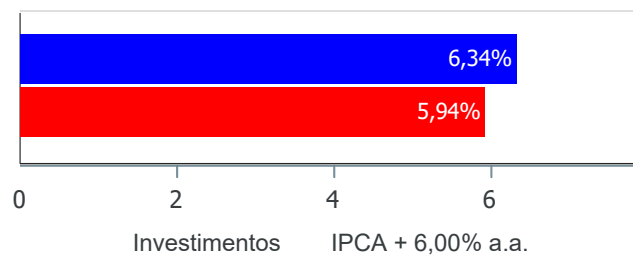
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Julho / 2019)



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%

Investimentos x Meta Atuarial



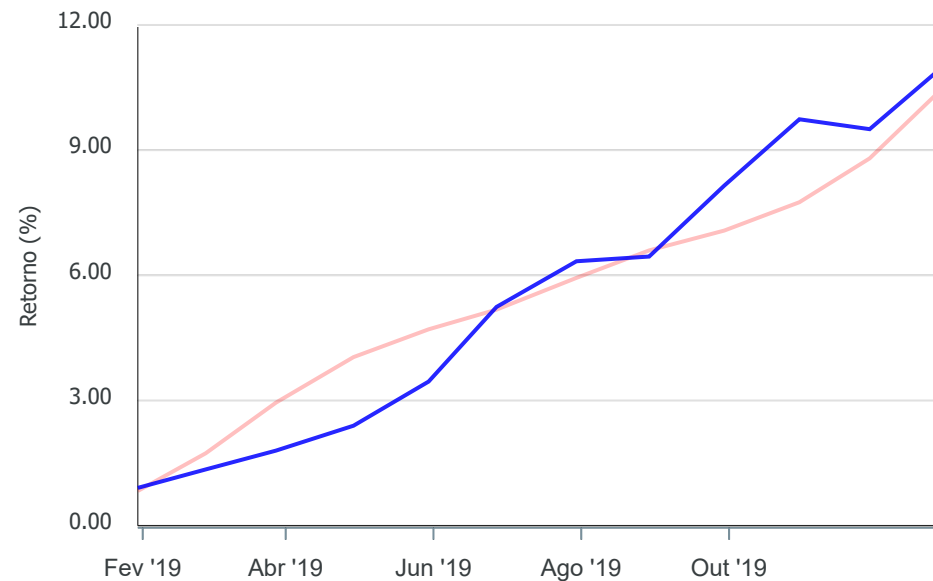
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Julho/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.039.656,13	101.047,42	0,00	1.154.979,97	14.276,42	1,25%	1,27%	1,34%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.489.317,42	0,00	0,00	1.505.800,00	16.482,58	1,11%	1,11%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.356.237,07	0,00	0,00	1.369.083,24	12.846,17	0,95%	0,95%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.164.162,96	0,00	0,00	1.174.843,23	10.680,27	0,92%	0,92%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.186.493,29	0,00	0,00	1.194.797,22	8.303,93	0,70%	0,70%	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	348.258,79	0,00	0,00	350.200,65	1.941,86	0,56%	0,56%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	473.803,72	0,00	0,00	476.411,46	2.607,74	0,55%	0,55%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	657.778,64	336.274,23	922.867,69	71.553,02	367,84	0,04%	0,49%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	109.607,82	109.088,22	530,65	11,05	0,01%	0,11%	0,00%
Total Renda Fixa	7.715.708,02	546.929,47	1.031.955,91	7.298.199,44	67.517,86	0,82%		0,68%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	515.698,29	0,00	0,00	533.800,61	18.102,32	3,51%	3,51%	4,72%
Total Renda Variável	515.698,29	0,00	0,00	533.800,61	18.102,32	3,51%		4,72%