

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2019

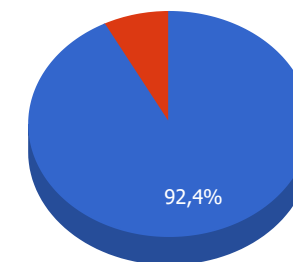
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2019)

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	1.039.656,13	12,63%	909	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.186.493,29	14,41%	1.419	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.356.237,07	16,48%	889	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.164.162,96	14,14%	920	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.489.317,42	18,09%	560	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	348.258,79	4,23%	411	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	657.778,64	7,99%	328	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	473.803,72	5,76%	821	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	515.698,29	6,27%	1.645	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			8.231.406,31				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			112.095,42				Artigo 6º
PL Total			8.343.501,73				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 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%	8.231.406,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.746.549,45	57,66%	50,00%	60,00%	100,00%	3.484.856,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	8.231.406,31
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	411.570,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.938.843,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.938.843,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.479.841,15	17,98%	0,00%	20,00%	40,00%	1.812.721,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	3.292.562,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.646.281,26
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	1.234.710,95
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.234.710,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	411.570,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	411.570,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	411.570,32
Total Renda Fixa	100,00%	6.226.390,60	75,64%	50,00%	90,00%	570,00%	

Distribuição por Segmento

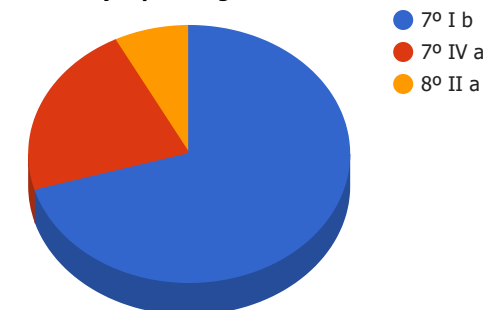


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 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%	2.469.421,89
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	2.469.421,89
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	515.698,29	6,27%	0,00%	5,00%	20,00%	1.130.582,97
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.646.281,26
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	823.140,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	411.570,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	411.570,32
Total Renda Variável	30,00%	515.698,29	6,27%	0,00%	10,00%	120,00%	

Distribuição por Artigos



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,98%	3,39%	5,98%	12,17%	23,08%	0,01%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,23%	1,74%	3,23%	7,09%	15,23%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,70%	7,17%	4,20%	7,17%	14,47%	25,32%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,69%	15,08%	9,06%	15,08%	28,54%	38,72%	0,02%	0,08%
CDI (Benchmark)	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	3,01%	1,50%	3,01%	6,17%	13,82%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,00%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,48%	3,06%	1,58%	3,06%	6,22%	13,89%	0,00%	0,00%

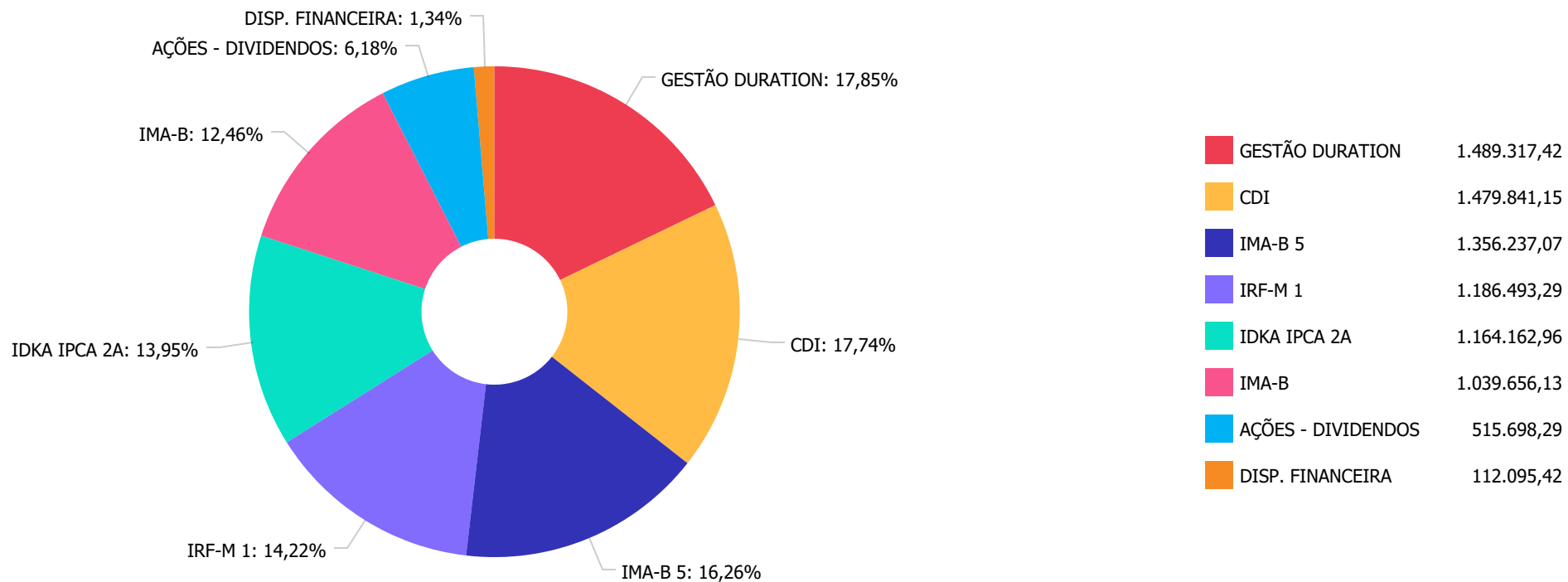
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,45%	13,61%	5,86%	13,61%	41,58%	47,38%	0,05%	0,19%

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



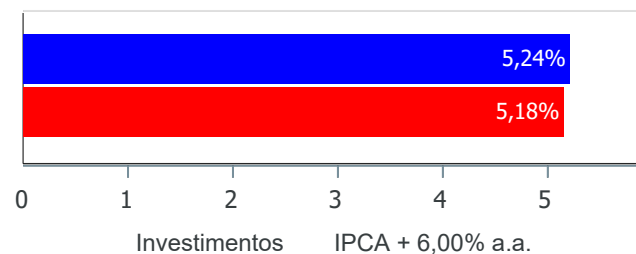
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2019)



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%

Investimentos x Meta Atuarial



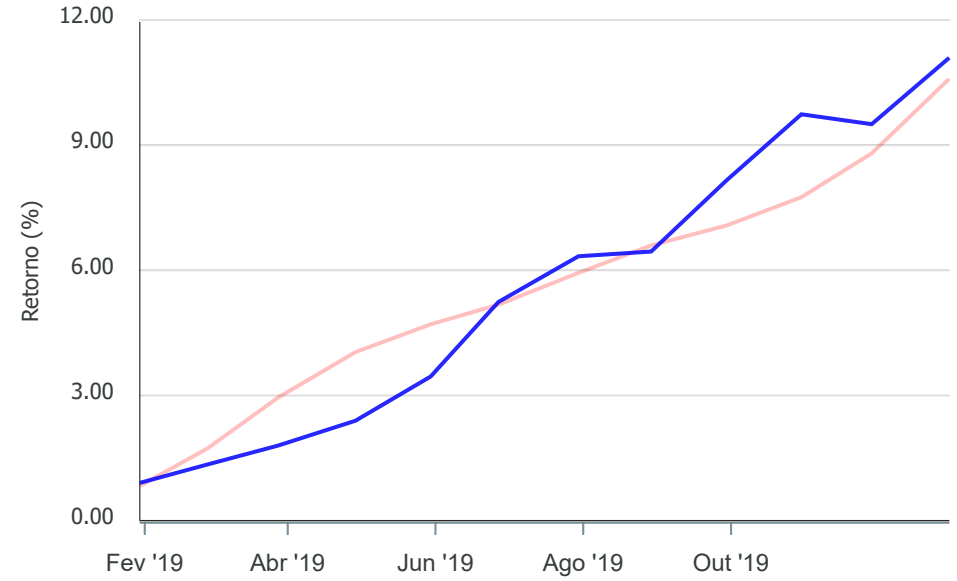
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Junho/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 ...	1.002.618,05	0,00	0,00	1.039.656,13	37.038,08	3,69%	3,69%	2,31%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.449.671,76	0,00	0,00	1.489.317,42	39.645,66	2,73%	2,73%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.333.589,22	0,00	0,00	1.356.237,07	22.647,85	1,70%	1,70%	1,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.174.825,14	0,00	24.698,17	1.164.162,96	14.035,99	1,19%	1,22%	0,95%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.179.728,03	0,00	0,00	1.186.493,29	6.765,26	0,57%	0,57%	0,15%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	346.584,92	0,00	0,00	348.258,79	1.673,87	0,48%	0,48%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	471.661,93	0,00	0,00	473.803,72	2.141,79	0,45%	0,45%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	946.121,51	288.545,30	657.778,64	202,43	0,02%	0,41%	0,00%
Total Renda Fixa	6.958.679,05	946.121,51	313.243,47	7.715.708,02	124.150,93	1,64%		1,04%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	515.698,29	15.698,29	3,14%	3,45%	5,42%
Total Renda Variável	0,00	500.000,00	0,00	515.698,29	15.698,29	3,14%		5,42%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/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	1.591.297,96	94.059,93	300.000,00	1.489.317,42	103.959,53	6,17%	6,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.627.698,41	0,00	3.500.000,00	1.186.493,29	58.794,88	1,27%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.000.039,00	0,00	1.039.656,13	39.617,13	3,96%	9,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	1.333.589,22	0,00	1.356.237,07	22.647,85	1,70%	4,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	1.174.825,14	24.698,17	1.164.162,96	14.035,99	1,19%	3,39%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	466.782,95	0,00	0,00	473.803,72	7.020,77	1,50%	1,50%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	342.844,61	0,00	0,00	348.258,79	5.414,18	1,58%	1,58%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	946.121,51	288.545,30	657.778,64	202,43	0,02%	1,33%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	74.825,14	872.275,31	947.198,35	0,00	97,90	0,01%	0,29%
				Total Renda Fixa	251.790,66	3,37%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/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	515.698,29	15.698,29	3,14%	5,86%
				Total Renda Variável	15.698,29	3,14%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/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	414.015,48	300.000,00	1.489.317,42	153.906,75	9,41%	10,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.465.818,21	804.997,76	4.207.000,00	1.186.493,29	122.677,32	2,33%	3,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.000.039,00	0,00	1.039.656,13	39.617,13	3,96%	15,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	1.333.589,22	0,00	1.356.237,07	22.647,85	1,70%	7,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	1.174.825,14	24.698,17	1.164.162,96	14.035,99	1,19%	5,98%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	459.949,54	0,00	0,00	473.803,72	13.854,18	3,01%	3,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	337.906,39	0,00	0,00	348.258,79	10.352,40	3,06%	3,06%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.686,01	3.279.108,92	3.287.446,27	0,00	651,34	0,02%	0,58%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	946.121,51	288.545,30	657.778,64	202,43	0,02%	2,65%
				Total Renda Fixa	377.945,39	5,15%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/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	515.698,29	15.698,29	3,14%	13,61%
				Total Renda Variável	15.698,29	3,14%	