

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2019

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

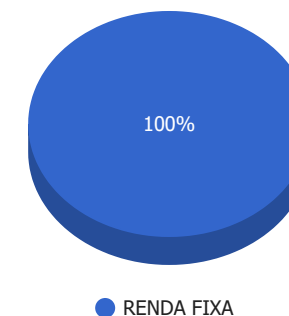
Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2019)

| 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 | 1.002.618,05 | 14,41% | 854 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 1.179.728,03 | 16,95% | 1.439 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 1.333.589,22 | 19,16% | 864 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 1.174.825,14 | 16,88% | 897 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 346.584,92 | 4,98% | 413 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 1.449.671,76 | 20,83% | 513 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 471.661,93 | 6,78% | 830 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 6.958.679,05 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 32.726,53 | | | | Artigo 6º |
| PL Total | | | 6.991.405,58 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 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% | 6.958.679,05 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 4.690.760,44 | 67,41% | 50,00% | 60,00% | 100,00% | 2.267.918,61 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% | 6.958.679,05 |
| Artigo 7º, Inciso II | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 347.933,95 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 4.175.207,43 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 4.175.207,43 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40,00% | 818.246,85 | 11,76% | 0,00% | 20,00% | 40,00% | 1.965.224,77 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 40,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 40,00% | 2.783.471,62 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 1.391.735,81 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 15,00% | 1.043.801,86 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 15,00% | 1.043.801,86 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 347.933,95 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 347.933,95 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 347.933,95 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 5.509.007,29 | 79,17% | 50,00% | 90,00% | 570,00% | |

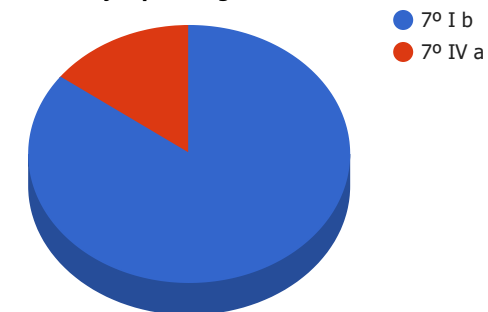
Distribuição por Segmento



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 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% | 2.087.603,72 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 30,00% | 2.087.603,72 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 20,00% | 1.391.735,81 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 1.391.735,81 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 695.867,91 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 347.933,95 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 347.933,95 |
| 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 (Maio / 2019)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-------------------------|--------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 6.958.679,05 | 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 ' | 4.690.760,44 | 67,41 | 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 ' | 2.267.918,61 | 32,59 | 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 |

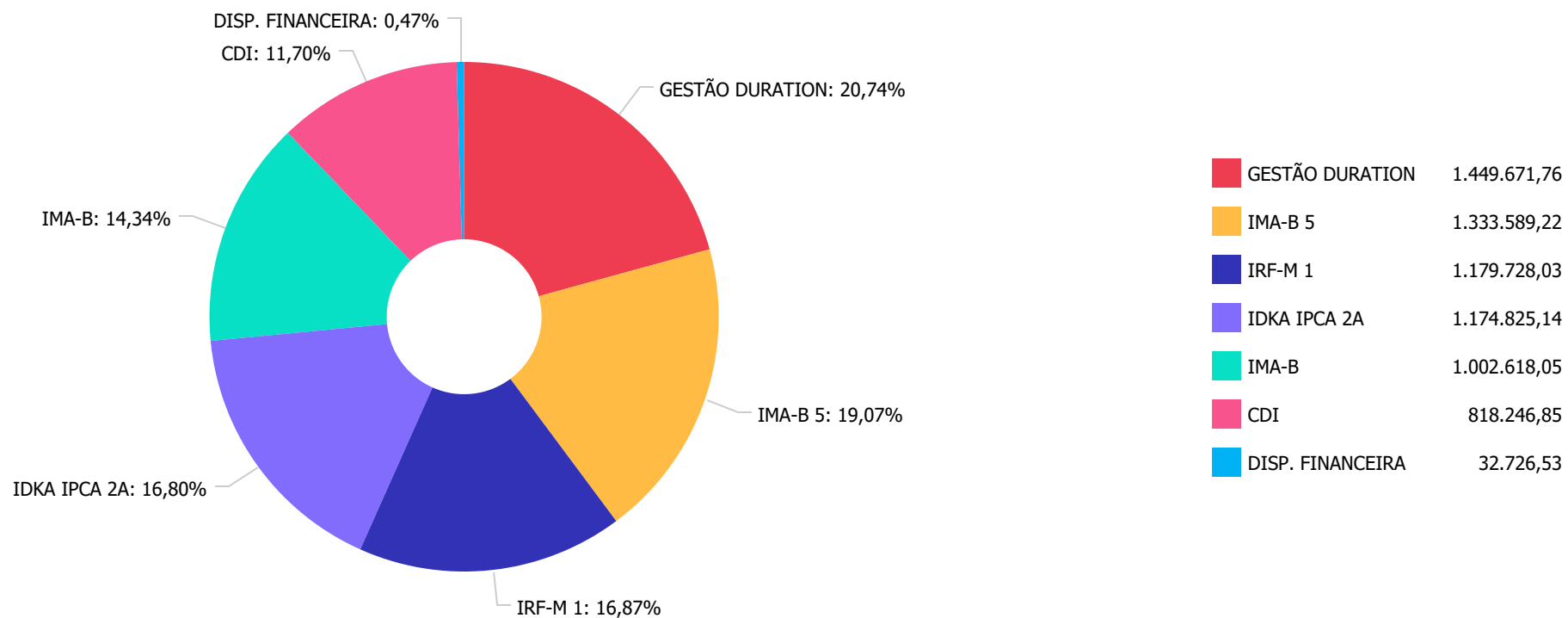
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2019 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 1,37% | 4,95% | 3,10% | 6,27% | 12,05% | 24,00% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,06% | 4,70% | 2,82% | 5,91% | 11,05% | 22,36% | 0,01% | 0,02% |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,68% | 2,72% | 1,66% | 3,30% | 7,19% | 15,95% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,65% | 2,64% | 1,61% | 3,20% | 7,01% | 15,56% | 0,00% | 0,01% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,39% | 5,47% | 3,31% | 6,91% | 13,22% | 24,34% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,37% | 5,38% | 3,25% | 6,83% | 13,03% | 23,86% | 0,01% | 0,03% |
| IMA-B (Benchmark) | 3,66% | 11,06% | 5,83% | 12,89% | 23,73% | 34,52% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3,63% | 10,98% | 5,77% | 12,79% | 23,51% | 33,98% | 0,02% | 0,06% |
| CDI (Benchmark) | 0,54% | 2,59% | 1,54% | 3,10% | 6,37% | 14,52% | - | - |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,54% | 2,55% | 1,52% | 3,04% | 6,22% | 14,24% | 0,00% | 0,00% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,57% | 2,57% | 1,55% | 3,06% | 6,22% | 14,27% | 0,00% | 0,00% |

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



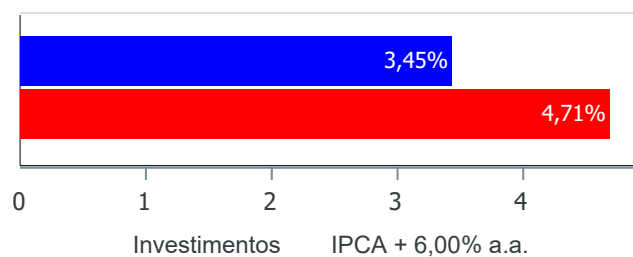
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2019)



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% |
| Maio | 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% |

Investimentos x Meta Atuarial



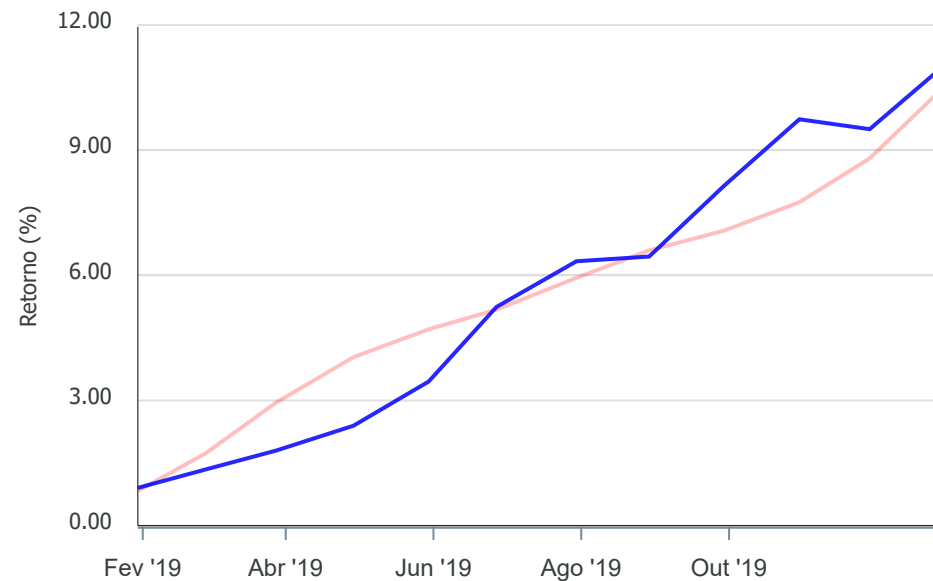
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/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 | 1.703.951,40 | 0,00 | 300.000,00 | 1.449.671,76 | 45.720,36 | 2,68% | 2,72% | 1,51% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 4.650.905,15 | 0,00 | 3.500.000,00 | 1.179.728,03 | 28.822,88 | 0,62% | 0,65% | 0,10% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 344.627,76 | 0,00 | 0,00 | 346.584,92 | 1.957,16 | 0,57% | 0,57% | 0,04% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 469.147,66 | 0,00 | 0,00 | 471.661,93 | 2.514,27 | 0,54% | 0,54% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 0,00 | 1.000.039,00 | 0,00 | 1.002.618,05 | 2.579,05 | 0,26% | 3,63% | 2,13% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 728.581,36 | 0,00 | 728.619,53 | 0,00 | 38,17 | 0,01% | 0,10% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 0,00 | 1.333.589,22 | 0,00 | 1.333.589,22 | 0,00 | 0,00% | 1,37% | 0,86% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 0,00 | 1.174.825,14 | 0,00 | 1.174.825,14 | 0,00 | 0,00% | 1,06% | 0,63% |
| Total Renda Fixa | 7.897.213,33 | 3.508.453,36 | 4.528.619,53 | 6.958.679,05 | 81.631,89 | 0,72% | | 0,91% |