

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.978.634,39	19,65%	879	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.327.999,61	13,19%	897	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.382.149,80	13,73%	1.359	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.766.296,82	17,54%	967	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.298.054,09	12,89%	998	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	224.980,52	2,23%	298	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	7.481,43	0,07%	15.934	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	365.749,31	3,63%	406	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	496.182,02	4,93%	651	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	365.115,61	3,63%	15.441	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	556.195,37	5,52%	5.654	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	298.976,14	2,97%	18.737	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			10.067.815,11				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			513.443,75				Artigo 6º
PL Total			10.581.258,86				

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

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

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.067.815,11	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 Novembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,25%	6,77%	1,31%	4,33%	8,05%	20,89%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	6,28%	1,41%	4,27%	7,44%	19,53%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,23%	3,52%	0,54%	1,19%	3,95%	11,13%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	3,34%	0,49%	1,09%	3,75%	10,71%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,32%	6,10%	1,40%	3,99%	7,41%	21,69%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	5,82%	1,31%	3,83%	7,10%	21,07%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	2,00%	1,48%	0,67%	5,31%	3,52%	26,83%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,99%	1,17%	0,62%	5,19%	3,18%	26,04%	0,02%	0,10%
CDI (Benchmark)	0,15%	2,59%	0,46%	1,03%	2,97%	9,24%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16%	2,05%	0,27%	0,91%	2,40%	8,40%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,08%	1,81%	0,26%	0,61%	2,12%	7,43%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,89%	3,13%	2,41%	3,29%	4,31%	7,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	5,27%	0,21%	1,37%	5,90%	24,20%	0,01%	0,02%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

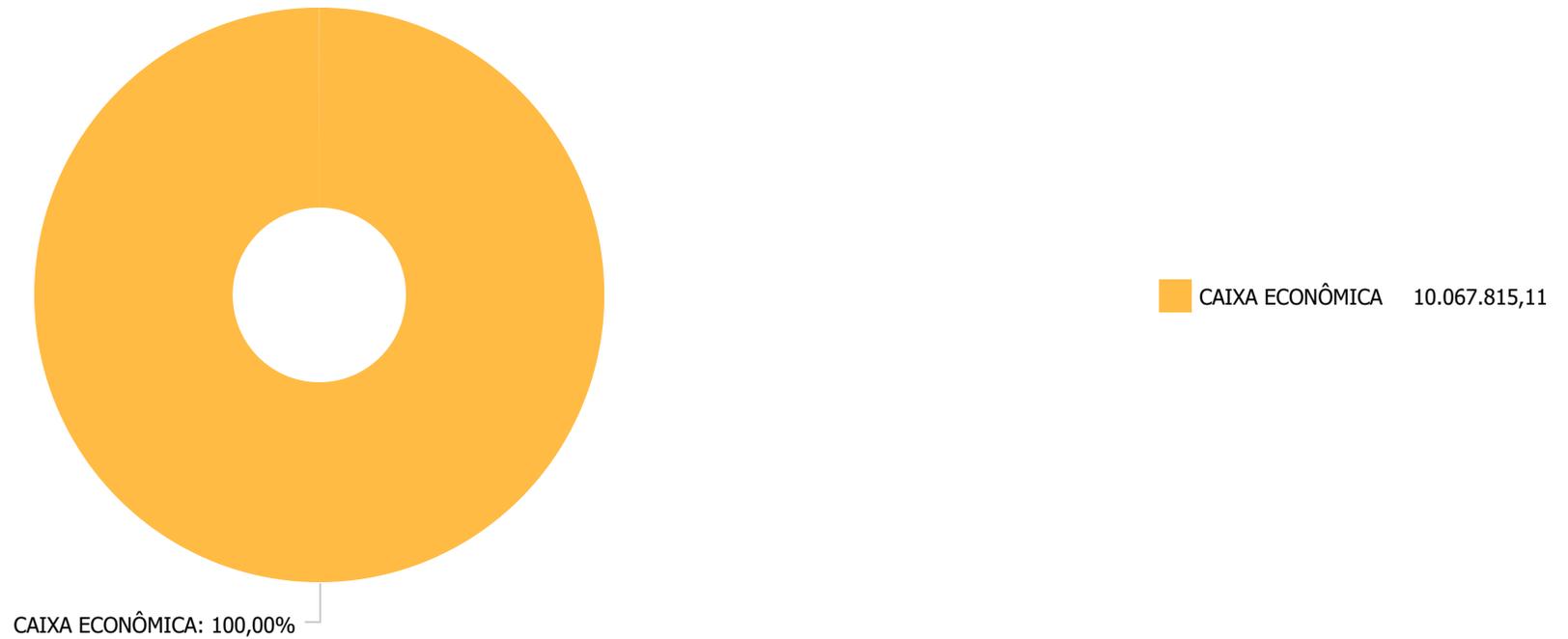
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	2,20%	0,03%	0,58%	2,58%	8,76%	0,00%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,13%	0,03%	0,06%	0,18%	1,21%	0,00%	0,00%

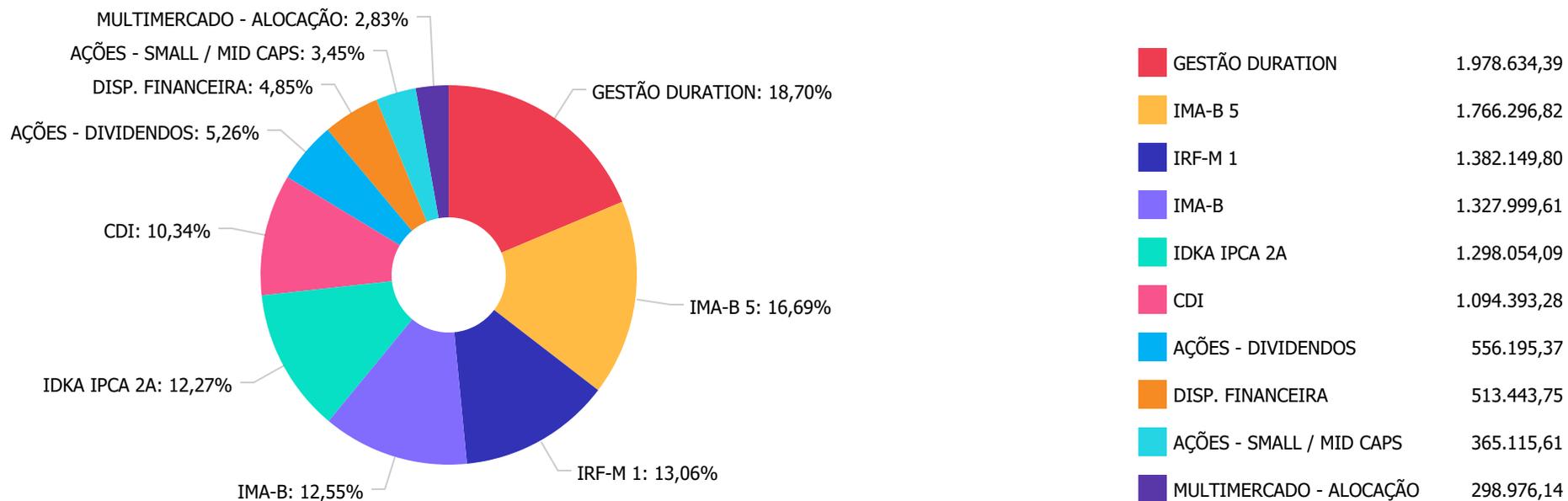
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	16,64%	-7,60%	7,78%	33,38%	4,09%	49,24%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15,73%	-10,07%	6,25%	29,26%	1,22%	41,06%	0,11%	0,48%
CDI (Benchmark)	0,15%	2,59%	0,46%	1,03%	2,97%	9,24%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4,02%	-0,04%	1,50%	5,85%	2,18%	13,35%	0,03%	0,12%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	16,18%	-13,56%	11,53%	12,21%	-3,00%	24,51%	0,11%	0,40%

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



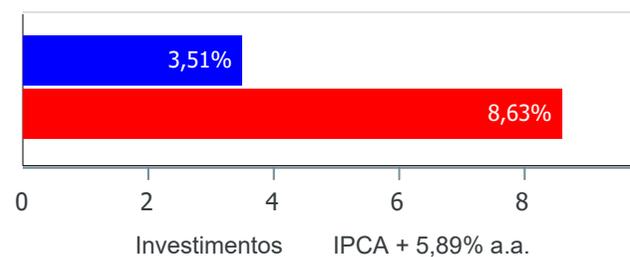
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Novembro / 2020)



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%
Fevereiro	8.884.516,53	1.685.687,83	1.830.442,47	8.726.644,90	-13.116,99	37.881,12	-0,15%	0,41%	0,66%	1,38%	29,71%	1,93%
Março	8.726.644,90	1.510.775,02	1.388.381,42	8.554.015,47	-295.023,03	-257.141,91	-3,33%	-2,94%	0,57%	1,96%	-150,19%	8,52%
Abril	8.554.015,47	938.600,37	119.360,61	9.476.461,41	103.206,18	-153.935,73	1,10%	-1,87%	0,14%	2,10%	-88,90%	4,30%
Mai	9.476.461,41	886.392,10	1.275.216,27	9.210.432,83	122.795,59	-31.140,14	1,30%	-0,60%	0,07%	2,18%	-27,46%	2,73%
Junho	9.210.432,83	2.031.331,57	1.932.385,34	9.442.314,01	132.934,95	101.794,81	1,43%	0,82%	0,74%	2,93%	28,00%	2,26%
Julho	9.442.314,01	2.916.774,29	2.152.188,97	10.372.556,37	165.657,04	267.451,85	1,62%	2,46%	0,89%	3,85%	63,92%	1,59%
Agosto	10.372.556,37	633.660,79	38.605,84	10.912.187,60	-55.423,72	212.028,13	-0,51%	1,94%	0,72%	4,59%	42,25%	1,49%
Setembro	10.912.187,60	566.546,45	780.774,07	10.620.855,43	-77.104,55	134.923,58	-0,71%	1,22%	1,12%	5,76%	21,16%	2,15%
Outubro	10.620.855,43	240.346,02	990.548,81	9.870.976,48	323,84	135.247,42	0,00%	1,22%	1,34%	7,18%	17,02%	2,02%
Novembro	9.870.976,48	541.498,81	567.485,92	10.067.815,11	222.825,74	358.073,16	2,26%	3,51%	1,35%	8,63%	40,64%	1,86%

Investimentos x Meta Atuarial



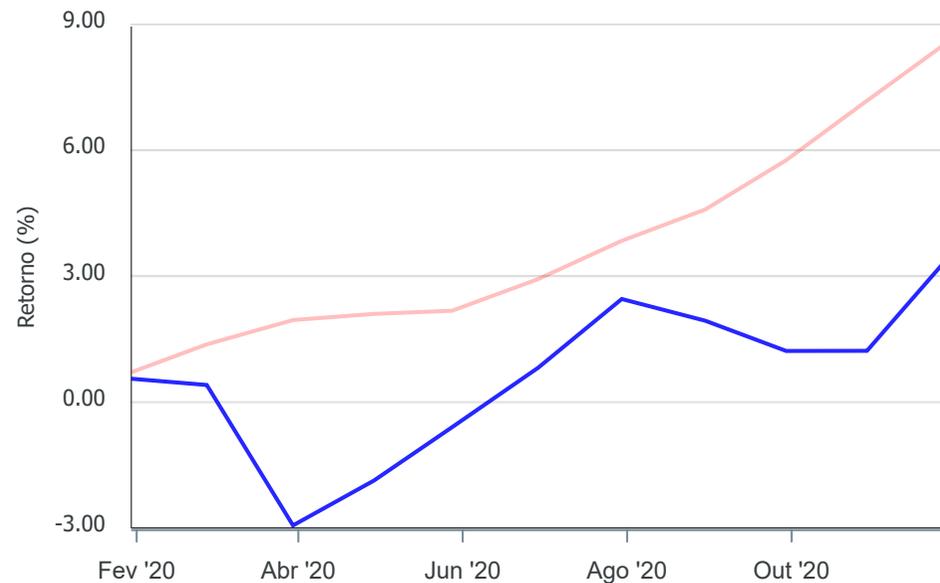
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Novembro/2020

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 ...	1.302.107,45	0,00	0,00	1.327.999,61	25.892,16	1,99%	1,99%	2,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.743.838,83	0,00	0,00	1.766.296,82	22.457,99	1,29%	1,29%	0,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.282.435,24	0,00	0,00	1.298.054,09	15.618,85	1,22%	1,22%	0,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.962.541,90	0,00	0,00	1.978.634,39	16.092,49	0,82%	0,82%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.379.176,08	0,00	0,00	1.382.149,80	2.973,72	0,22%	0,22%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	495.415,23	0,00	0,00	496.182,02	766,79	0,15%	0,15%	0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	365.407,35	0,00	0,00	365.749,31	341,96	0,09%	0,09%	0,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	253.404,51	309.696,79	338.164,82	224.980,52	44,04	0,01%	0,08%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.995,31	231.802,02	229.321,10	7.481,43	5,20	0,00%	0,01%	0,00%
Total Renda Fixa	8.789.321,90	541.498,81	567.485,92	8.847.527,99	84.193,20	0,90%		0,84%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	478.729,46	0,00	0,00	556.195,37	77.465,91	16,18%	16,18%	11,50%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	315.494,05	0,00	0,00	365.115,61	49.621,56	15,73%	15,73%	10,99%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	287.431,07	0,00	0,00	298.976,14	11.545,07	4,02%	4,02%	2,85%
Total Renda Variável	1.081.654,58	0,00	0,00	1.220.287,12	138.632,54	12,82%		9,23%