

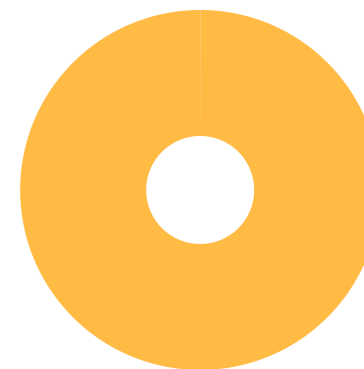
Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.303.085,15	60,08%	1.418	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.994.957,70	16,41%	707	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	952.393,78	7,83%	108	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	953.075,89	7,84%	736	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	952.791,15	7,84%	425	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			12.156.303,67				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			41.923,07				Artigo 6º
PL Total			12.198.226,74				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2018)

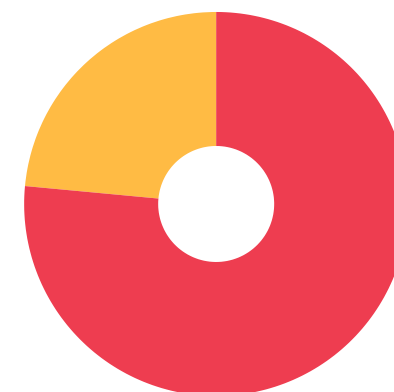
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	9.298.042,85	76,49%	50,00%	75,00%	100,00%	2.858.260,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	12.156.303,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	7.293.782,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	7.293.782,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	2.858.260,82	23,51%	0,00%	15,00%	40,00%	2.004.260,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	4.862.521,47
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.215.630,37
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.823.445,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	607.815,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	607.815,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	607.815,18
Total Renda Fixa	100,00%	12.156.303,67	100,00%	50,00%	90,00%	440,00%	



RENDA FIXA 12.156.303,67

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2018)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.431.260,73
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.431.260,73
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	2.431.260,73
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.431.260,73
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	1.215.630,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	607.815,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	607.815,18
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	



7º I b 7º IV a

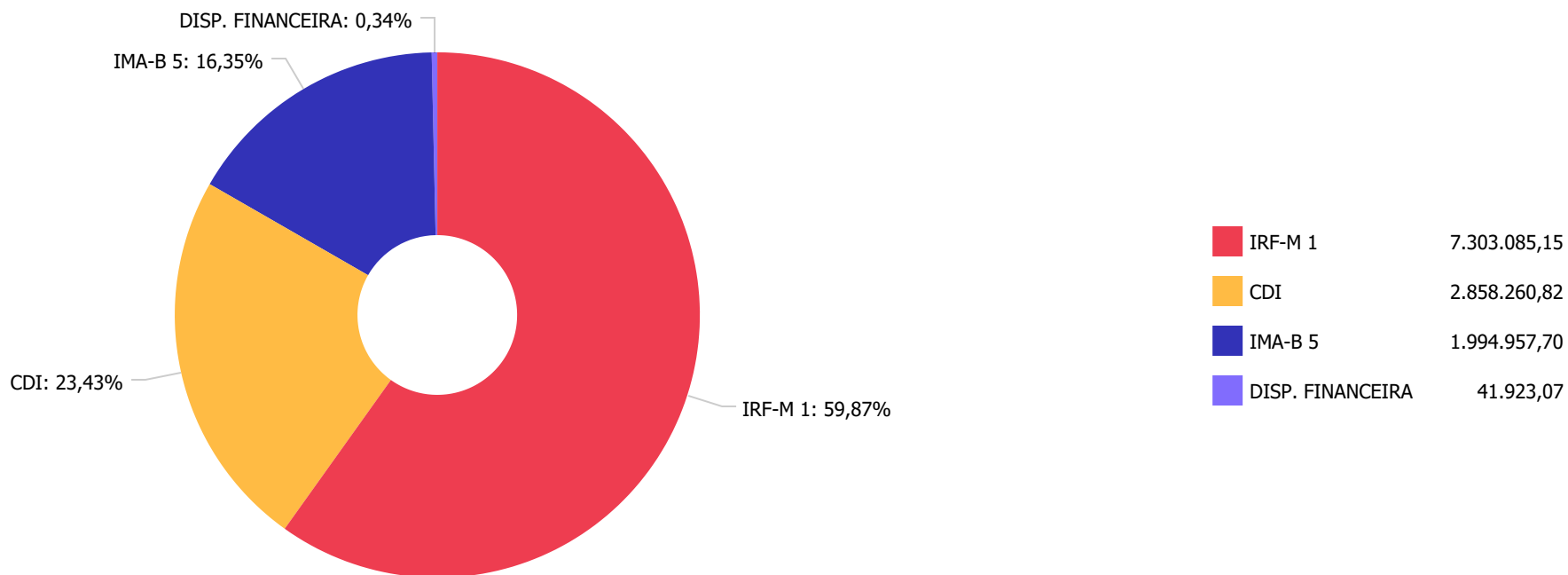
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2018 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,59%	0,59%	1,79%	4,11%	10,35%	26,16%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,74%	4,02%	10,18%	25,79%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,33%	1,33%	2,33%	5,17%	12,77%	27,94%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,31%	1,31%	2,28%	5,06%	12,57%	27,44%	0,01%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,57%	0,57%	1,66%	3,78%	9,39%	24,73%	0,00%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	0,57%	1,69%	3,82%	9,33%	24,61%	0,00%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,67%	3,80%	9,29%	24,55%	0,00%	0,00%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2018)



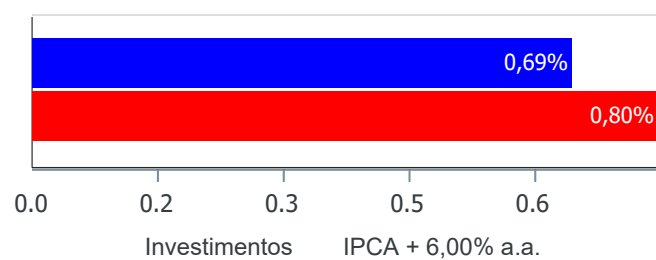
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2018)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	11.887.889,12	389.525,46	204.263,90	12.156.303,67	83.152,99	83.152,99	0,69%	0,69%	0,80%	0,80%	85,93%	0,16%

Investimentos x Meta Atuarial



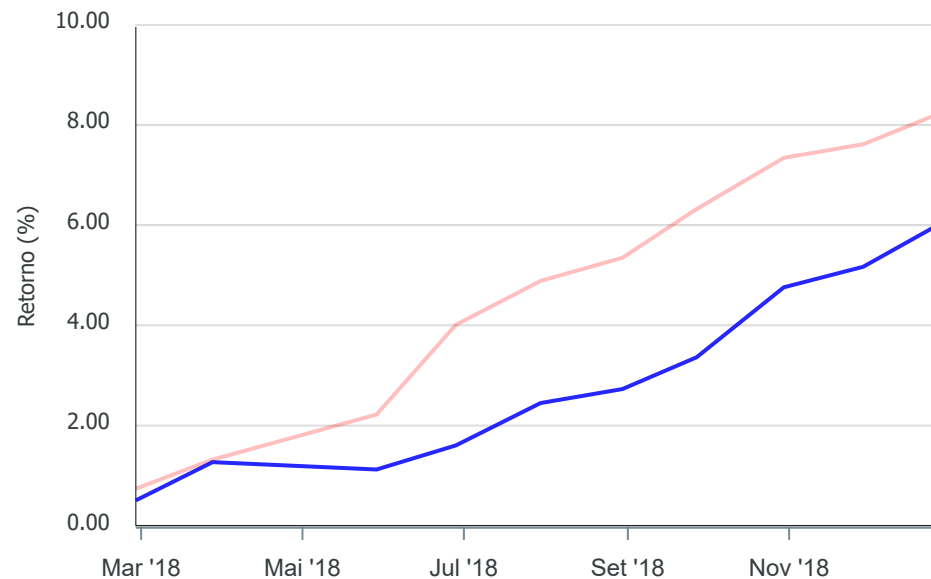
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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/2018

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.969.215,10	0,00	0,00	1.994.957,70	25.742,60	1,31%	1,31%	0,61%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	946.994,41	0,00	0,00	952.393,78	5.399,37	0,57%	0,57%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	947.401,74	0,00	0,00	952.791,15	5.389,41	0,57%	0,57%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	947.692,46	0,00	0,00	953.075,89	5.383,43	0,57%	0,57%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.076.585,41	389.525,46	204.263,90	7.303.085,15	41.238,18	0,55%	0,57%	0,10%
Total Renda Fixa	11.887.889,12	389.525,46	204.263,90	12.156.303,67	83.152,99	0,69%		0,16%