

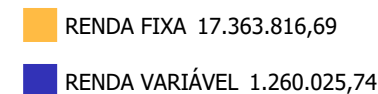
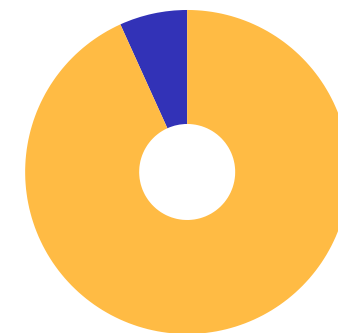
# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2020

**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 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	5.940.147,74	31,90%	717	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.042.287,18	27,07%	1.361	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.833.775,77	9,85%	922	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.786.071,28	14,96%	969	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	806.324,16	4,33%	78	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	955.210,56	5,13%	941	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	747.961,74	4,02%	18.810	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	512.064,00	2,75%	26.307	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>18.623.842,43</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>70.630,67</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>18.694.473,10</b>				

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

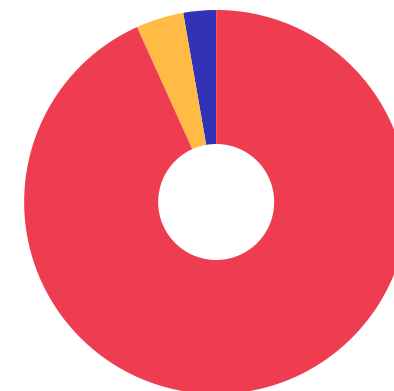
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	18.623.842,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	17.363.816,69	93,23%	40,00%	75,00%	100,00%	1.260.025,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	18.623.842,43
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	931.192,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	11.174.305,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	11.174.305,46
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	7.449.536,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	7.449.536,97
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	3.724.768,49
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.793.576,36
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.793.576,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	931.192,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	931.192,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	931.192,12
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>17.363.816,69</b>	<b>93,23%</b>	<b>40,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>570,00%</b>	



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2020)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	5.587.152,73
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	5.587.152,73
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	747.961,74	4,02%	0,00%	3,00%	20,00%	2.976.806,75
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	3.724.768,49
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	512.064,00	2,75%	0,00%	3,00%	10,00%	1.350.320,24
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	931.192,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	931.192,12
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>1.260.025,74</b>	<b>6,77%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.862.384,24
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.862.384,24
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.862.384,24
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    8º II a    8º III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.817.518,27	95,67	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	806.324,16	4,33	0,01

**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 Janeiro/2020 - RENDA FIXA**

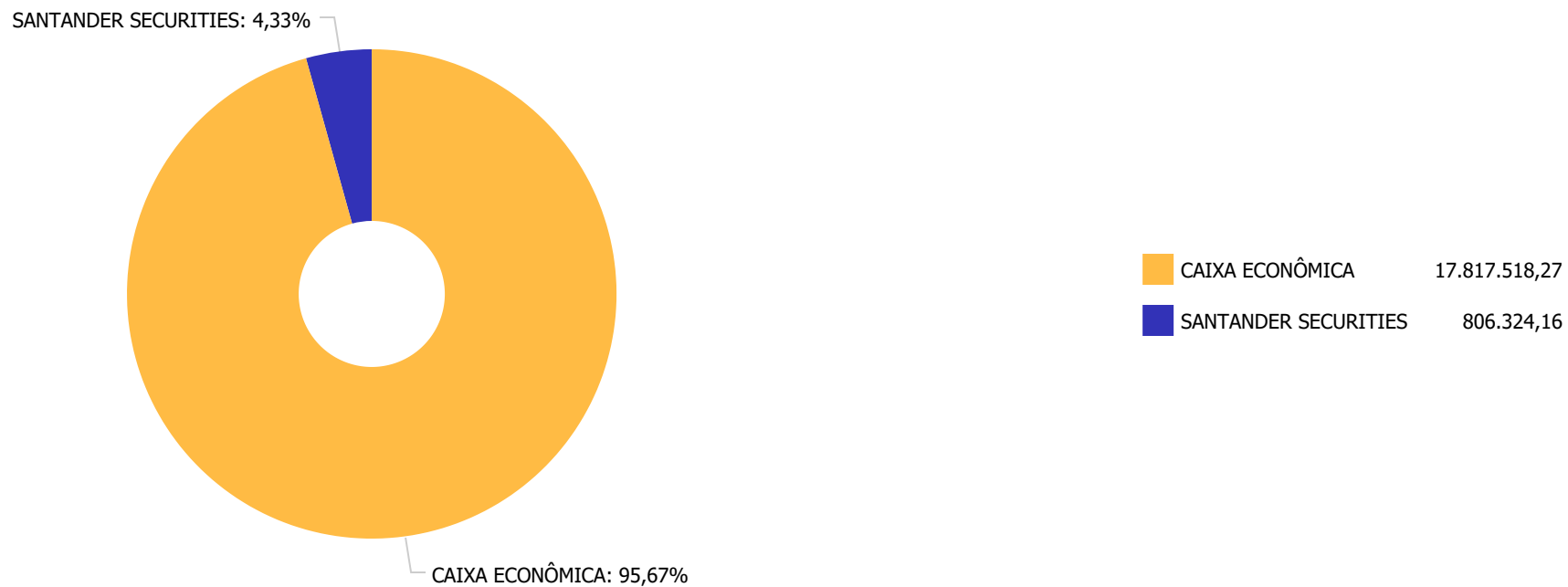
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	0,46%	1,57%	4,44%	10,30%	20,93%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	0,42%	1,14%	2,93%	6,40%	13,64%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,54%	1,41%	4,89%	11,76%	22,83%	0,01%	0,02%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,30%	0,30%	-0,11%	5,59%	17,11%	31,34%	0,02%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,25%	0,25%	-0,36%	5,44%	17,72%	34,14%	0,02%	0,06%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>SMLL (Benchmark)</b>	0,45%	0,45%	18,98%	24,82%	45,25%	64,69%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,50%	0,50%	18,51%	24,23%	41,26%	56,18%	0,09%	0,14%

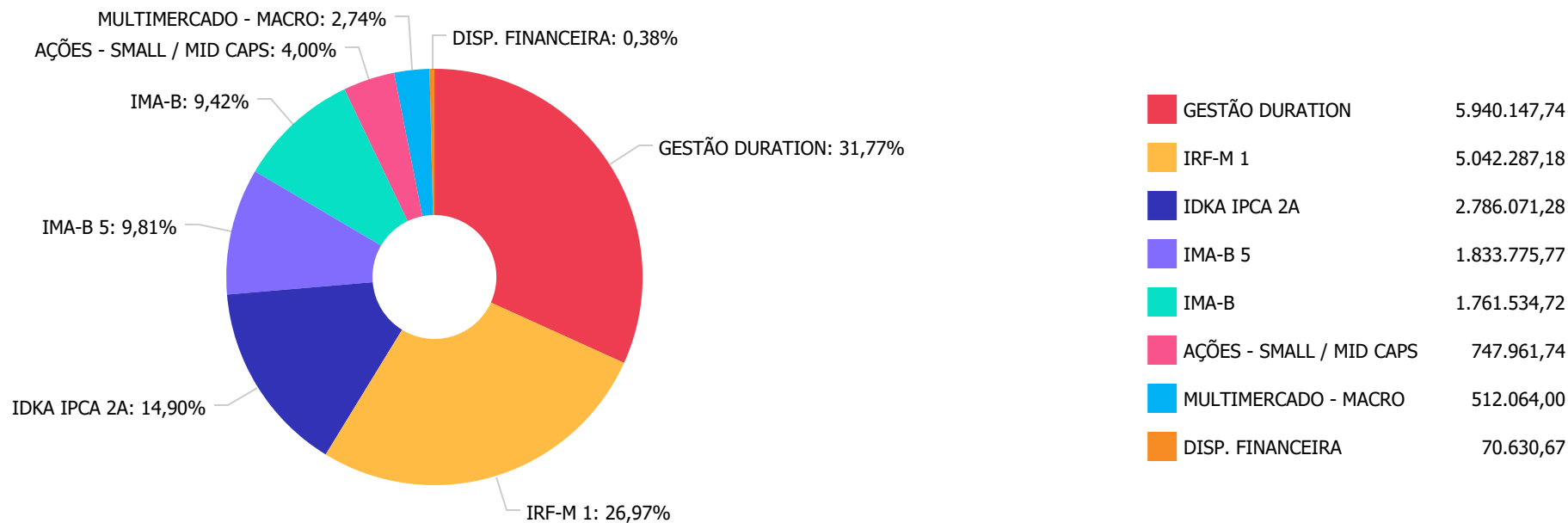
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,68%	0,68%	3,58%	6,70%	14,67%	28,07%	0,02%	0,02%

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





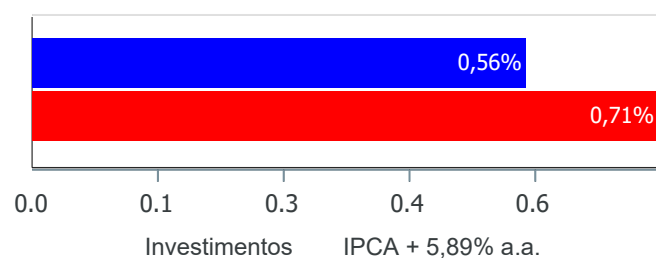
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

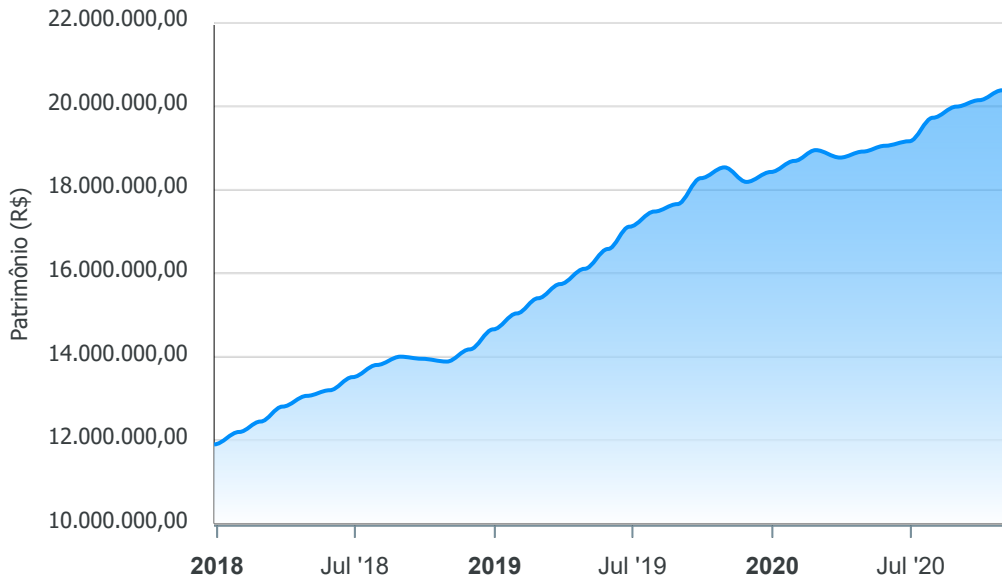
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	18.161.665,93	688.998,08	331.058,75	18.623.842,43	104.237,17	104.237,17	0,56%	0,56%	0,71%	0,71%	79,06%	0,96%

Investimentos x Meta Atuarial



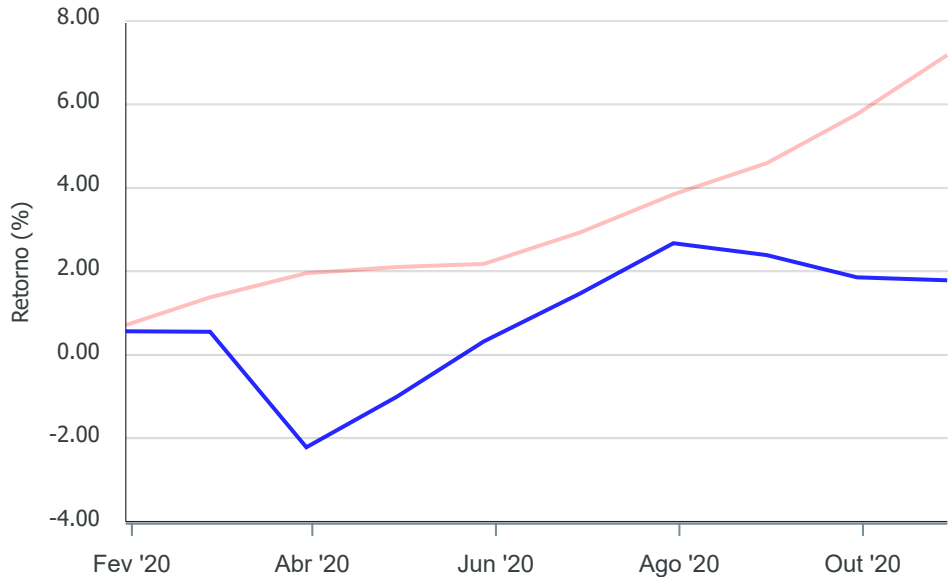
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2020

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	5.891.875,56	0,00	0,00	5.940.147,74	48.272,18	0,82%	0,82%	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.823.852,17	0,00	0,00	1.833.775,77	9.923,60	0,54%	0,54%	0,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.773.392,59	0,00	0,00	2.786.071,28	12.678,69	0,46%	0,46%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.662.951,43	688.998,08	331.058,75	5.042.287,18	21.396,42	0,40%	0,42%	0,09%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	803.920,85	0,00	0,00	806.324,16	2.403,31	0,30%	0,30%	1,62%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	952.860,23	0,00	0,00	955.210,56	2.350,33	0,25%	0,25%	1,67%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>16.908.852,83</b>	<b>688.998,08</b>	<b>331.058,75</b>	<b>17.363.816,69</b>	<b>97.024,53</b>	<b>0,56%</b>		<b>0,57%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	508.587,42	0,00	0,00	512.064,00	3.476,58	0,68%	0,68%	1,97%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	744.225,68	0,00	0,00	747.961,74	3.736,06	0,50%	0,50%	9,31%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.252.813,10</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.260.025,74</b>	<b>7.212,64</b>	<b>0,58%</b>		<b>6,33%</b>