

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	2.223.080,61	19,02%	731	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	2.829.037,93	24,21%	968	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	1.792.476,54	15,34%	922	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	1.123.270,91	9,61%	941	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	1.450.661,06	12,41%	1.359	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	531.444,00	4,55%	321	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	685.983,22	5,87%	684	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTI...	D+4	Não há	611.789,99	5,23%	25.577	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	438.886,40	3,76%	28.043	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			11.686.630,66				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			309.717,75	Artigo 6º			
PL Total			11.996.348,41				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Fevereiro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	9.418.527,05	80,59%	20,00%	30,00%	90,00%	1.099.440,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	7.011.978,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	1.217.427,22	10,42%	10,00%	30,00%	40,00%	3.457.225,04
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.752.994,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	584.331,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	584.331,53
Total Renda Fixa	100,00%	10.635.954,27	91,01%	30,00%	70,00%	215,00%	

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	2.337.326,13
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.050.676,39	8,99%	7,00%	10,00%	10,00%	117.986,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	584.331,53
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	1.050.676,39	8,99%	7,00%	30,00%	35,00%	

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	0,00	0,00	0,00	15,00
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 II, Alínea a	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	11.686.630,66	100,00	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,69%	1,22%	2,44%	5,37%	11,19%	22,52%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,60%	1,06%	2,17%	4,96%	10,35%	20,98%	0,69%	1,59%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,38%	0,82%	1,25%	2,87%	6,52%	13,85%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,36%	0,79%	1,19%	2,77%	6,31%	13,44%	0,07%	0,43%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,64%	1,20%	2,45%	5,66%	12,17%	23,49%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,63%	1,18%	2,40%	5,51%	11,87%	22,95%	0,86%	2,26%
IMA-B (Benchmark)	0,45%	0,71%	2,73%	6,54%	18,00%	34,65%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,44%	0,69%	2,69%	6,35%	17,63%	34,01%	2,42%	6,46%
CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27%	0,65%	1,00%	2,22%	5,33%	11,90%	0,02%	0,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,23%	0,53%	0,84%	1,97%	4,70%	10,48%	0,00%	0,27%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,62%	1,44%	2,04%	5,45%	14,23%	25,27%	0,91%	3,57%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	-1,51%	-0,84%	1,24%	4,45%	12,95%	25,31%	3,40%	3,49%
CAIXA RV 30 RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	-2,41%	-2,65%	-0,49%	3,15%	7,40%	15,22%	4,41%	3,99%

