

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2020

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 (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	1.779.102,21	11,56%	717	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.018.255,95	6,61%	615	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.206.496,01	7,84%	941	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.343.858,01	8,73%	969	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.025.949,22	6,66%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.477.773,13	9,60%	922	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.347,39	0,05%	67	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREV L...	D+0	Não há	44.157,87	0,29%	1.213	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	546.949,41	3,55%	888	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	174.536,88	1,13%	184	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	560.228,19	3,64%	288	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	33.703,71	0,22%	737	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	703.535,78	4,57%	489	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	586.484,46	3,81%	169	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	76.451,06	0,50%	324	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	141.006,67	0,92%	93	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	601.246,14	3,91%	165	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DJUNA MIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	370.021,94	2,40%	58.612	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.118.410,85	7,27%	2.823	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	576.486,86	3,75%	418	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

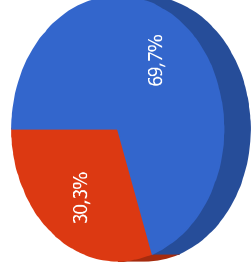
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	723.976,54	4,70%	211	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA RY 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.015.494,49	6,60%	26.379	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	260.800,28	1,69%	26.307	0,00%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			15.393.273,05				

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, Alinea 'b'	100,00%	8.450.889,20	54,90%	15,00%	25,00%	90,00%	5.403.056,55
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	9.235.963,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'	40,00%	2.275.946,75	14,79%	10,00%	30,00%	40,00%	3.881.362,47
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.308.990,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	769.663,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	769.663,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	769.663,65
Total Renda Fixa	100,00%	10.726.835,95	69,69%	25,00%	70,00%	220,00%	

Distribuição por Segmento

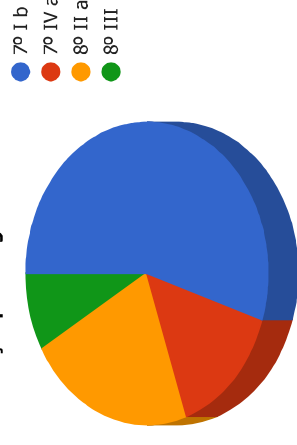


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

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 II, Alínea 'a'	20,00%	3.390.142,33	22,02%	7,00%	10,00%	20,00%	-311.487,72
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.276.294,77	8,29%	7,00%	10,00%	10,00%	263.032,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	769.663,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	769.663,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	769.663,65
Total Renda Variável	30,00%	4.666.437,10	30,31%	14,00%	30,00%	45,00%	

Distribuição por Artigos



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.539.327,31
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.148.877,71	65,93	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.219.553,80	14,42	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.539.843,66	10,00	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.484.997,88	9,65	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 %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea ' b '	8.450.889,20	54,90	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea ' a '	2.275.946,75	14,79	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VIII, Alinea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VIII, Alinea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alinea ' a '	3.390.142,33	22,02	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	1.276.294,77	8,29	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	0,38%	1,75%	4,52%	10,29%	20,76%	0,01%	0,02%
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%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,43%	0,43%	1,10%	2,90%	6,41%	13,53%	0,00%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,42%	1,13%	2,89%	6,33%	13,50%	0,00%	0,00%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,56%	0,56%	1,44%	4,92%	11,82%	22,86%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
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%
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,35%	0,35%	1,07%	2,47%	5,50%	11,93%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,30%	0,30%	0,92%	2,17%	4,90%	10,67%	0,00%	0,00%

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

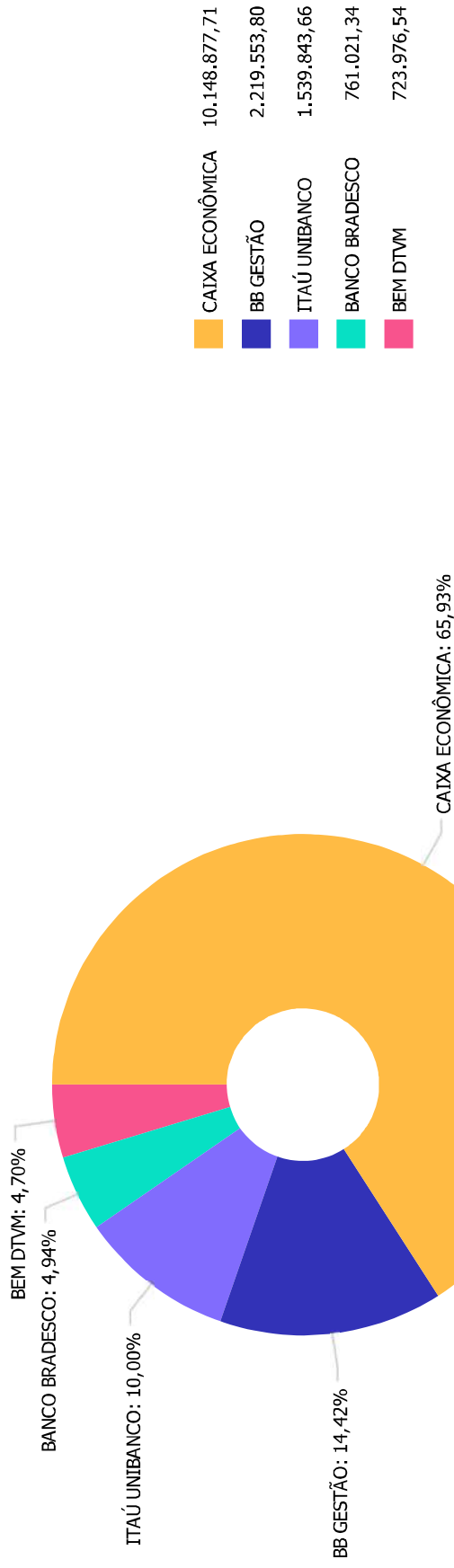
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	0,34%	1,04%	2,66%	9,69%	19,74%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,43%	0,43%	0,33%	3,87%	10,74%	21,90%	0,01%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	0,39%	1,08%	2,59%	5,77%	12,20%	0,00%	0,00%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,54%	0,54%	1,34%	4,79%	11,38%	19,85%	0,01%	0,02%

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

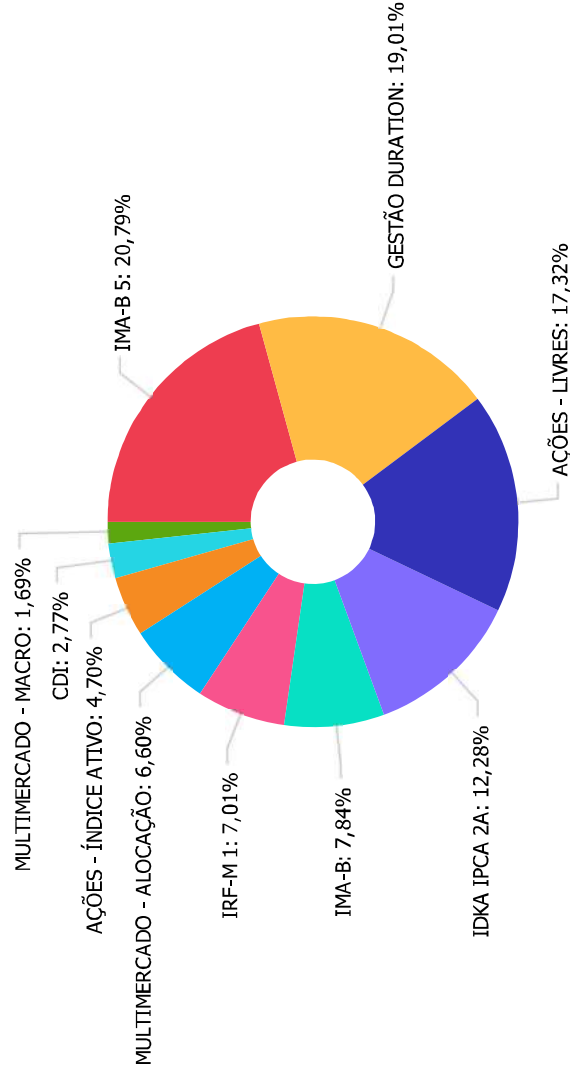
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	-1,38%	-1,38%	7,59%	13,66%	19,47%	37,50%	0,09%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,47%	1,47%	15,18%	17,48%	31,03%	65,96%	0,10%	0,11%
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	-1,29%	-1,29%	4,28%	11,26%	18,91%	40,76%	0,11%	0,09%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,19%	-0,19%	9,98%	18,27%	31,46%	59,14%	0,09%	0,10%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,17%	3,17%	14,95%	20,83%	-	-	0,08%	-

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,25%	-0,25%	3,09%	6,01%	9,71%	18,68%	0,03%	0,03%
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)

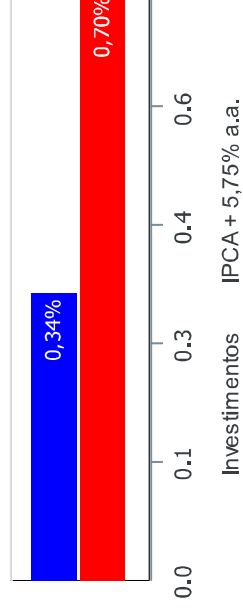


Sub-Segment	Value
IMA-B 5	3.199.564,86
GESTÃO DURATION	2.925.814,86
AÇÕES - LIVRES	2.666.165,79
IDKA IPCA 2A	1.890.807,42
IMA-B	1.206.496,01
IRF-M 1	1.078.454,48
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.015.494,49
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	723.976,54
CDI	425.698,32
MULTIMERCADO - MACRO	260.800,28

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

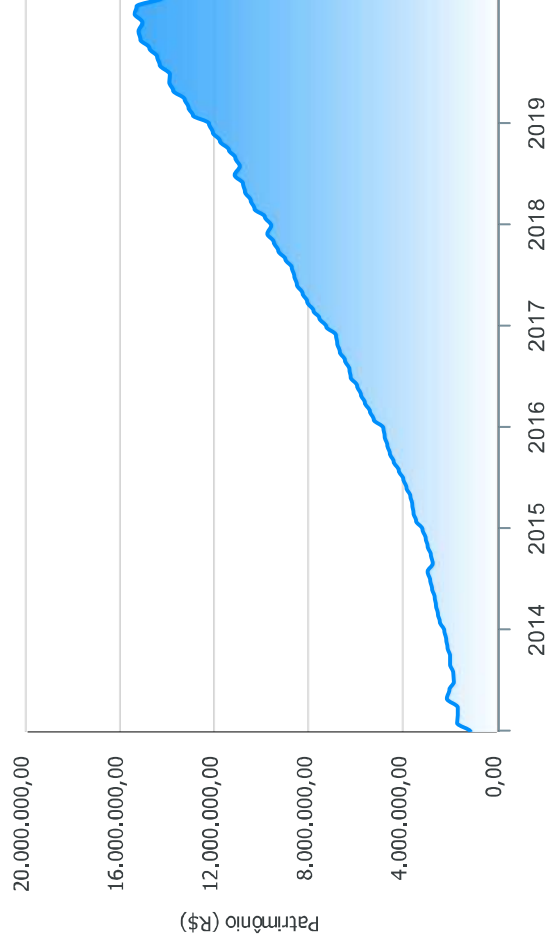
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	15.059.069,11	1.384.523,56	1.102.977,45	15.393.273,05	52.657,83	52.657,83	0,34%	0,34%	0,70%	0,70%	49,02%	2,67%

Investimentos x Meta Atuarial



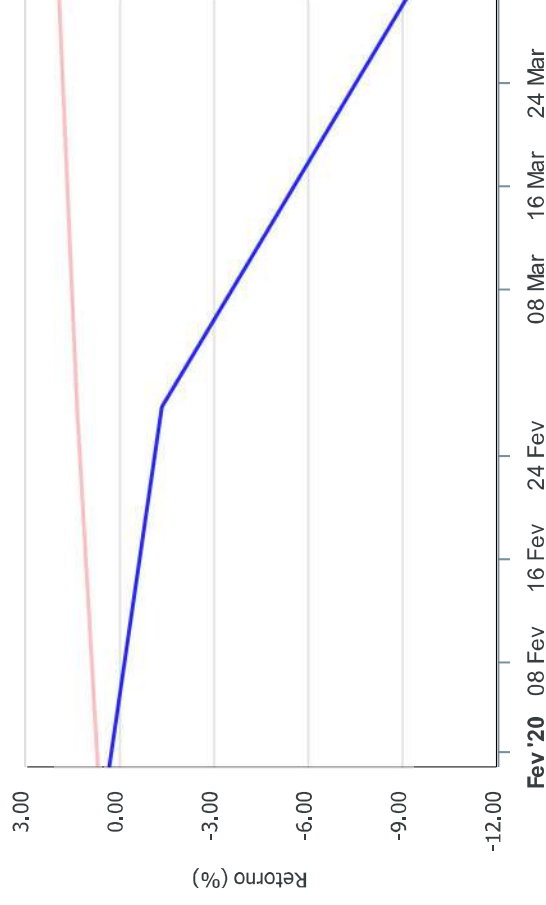
Gráficos Ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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	1.764.644,47	0,00	0,00	1.779.102,21	14.457,74	0,82%	0,82%	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.469.776,04	0,00	0,00	1.477.773,13	7.997,09	0,54%	0,54%	0,64%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	699.779,30	0,00	0,00	703.535,78	3.756,48	0,54%	0,54%	0,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.609.666,18	0,00	600.000,00	1.018.255,95	8.589,77	0,53%	0,56%	0,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.337.742,46	0,00	0,00	1.343.858,01	6.115,55	0,46%	0,46%	0,55%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	583.980,26	0,00	0,00	586.484,46	2.504,20	0,43%	0,43%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	1.021.632,06	0,00	0,00	1.025.949,22	4.317,16	0,42%	0,42%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	43.973,47	0,00	0,00	44.157,87	184,40	0,42%	0,42%	0,09%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	140.460,79	0,00	0,00	141.006,67	545,88	0,39%	0,39%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	544.851,79	0,00	0,00	546.949,41	2.097,62	0,38%	0,38%	0,55%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	173.925,73	0,00	0,00	174.536,88	611,15	0,35%	0,35%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA...	558.325,63	0,00	0,00	560.228,19	1.902,56	0,34%	0,34%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.203.527,38	0,00	0,00	1.206.496,01	2.968,63	0,25%	0,25%	1,67%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	33.629,51	0,00	33.703,71	74,20	0,22%	0,29%	0,00%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.187,26	104.921,75	100.000,00	8.347,39	238,38	0,22%	0,43%	0,09%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	82.698,57	146.455,53	152.977,45	76.451,06	274,41	0,12%	0,30%	0,00%
Total Renda Fixa	11.238.171,39	285.006,79	852.977,45	10.726.835,95	56.635,22	0,49%		0,62%

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 AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	597.405,33	499.516,77	0,00	1.118.410,85	21.488,75	1,96%	3,17%	7,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	592.552,93	0,00	0,00	601.246,14	8.693,21	1,47%	1,47%	9,71%
CAIXA ALOCAÇÃO MA CRO FIC MULTIMERCADO LP	259.029,62	0,00	0,00	260.800,28	1.770,66	0,68%	0,68%	1,97%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.267.756,45	0,00	250.000,00	1.015.494,49	-2.261,96	-0,18%	-0,25%	2,96%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	370.722,26	0,00	0,00	370.021,94	-700,32	-0,19%	-0,19%	8,70%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	733.431,13	0,00	0,00	723.976,54	-9.454,59	-1,29%	-1,29%	10,86%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIC AÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	576.486,86	-23.513,14	-3,92%	-1,38%	8,92%
Total Renda Variável	3.820.897,72	1.099.516,77	250.000,00	4.666.437,10	-3.977,39	-0,09%		7,39%