

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

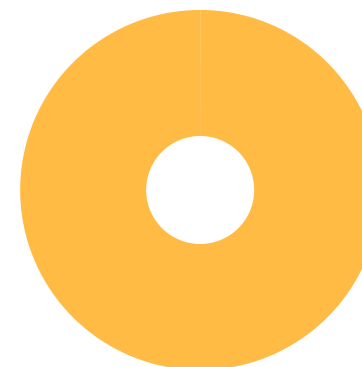
em janeiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2019)

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	47.143,12	3,35%	1.466	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.754,93	0,48%	738	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	40.111,33	2,85%	758	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.038,23	1,00%	362	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.184.152,45	84,16%	12	3,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	114.844,21	8,16%	70	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.407.044,27				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	94.009,38	6,68%	20,00%	30,00%	70,00%	890.921,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	844.226,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.198.190,68	85,16%	10,00%	27,00%	40,00%	-635.372,97
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	211.056,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	114.844,21	8,16%	0,00%	3,00%	5,00%	-44.492,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	70.352,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	70.352,21
Total Renda Fixa	100,00%	1.407.044,27	100,00%	35,00%	70,00%	200,00%	

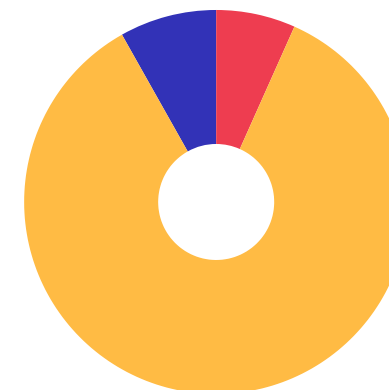


RENDA FIXA 1.407.044,27

⚠ ATENÇÃO! O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	20,00%	281.408,85
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	140.704,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	70.352,21
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	16,00%	30,00%	35,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º IV a
 ■ 7º VII a
 ■ 8º II a

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Janeiro / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.184.152,45	84,16	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	114.844,21	8,16	0,15
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	108.047,61	7,68	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)

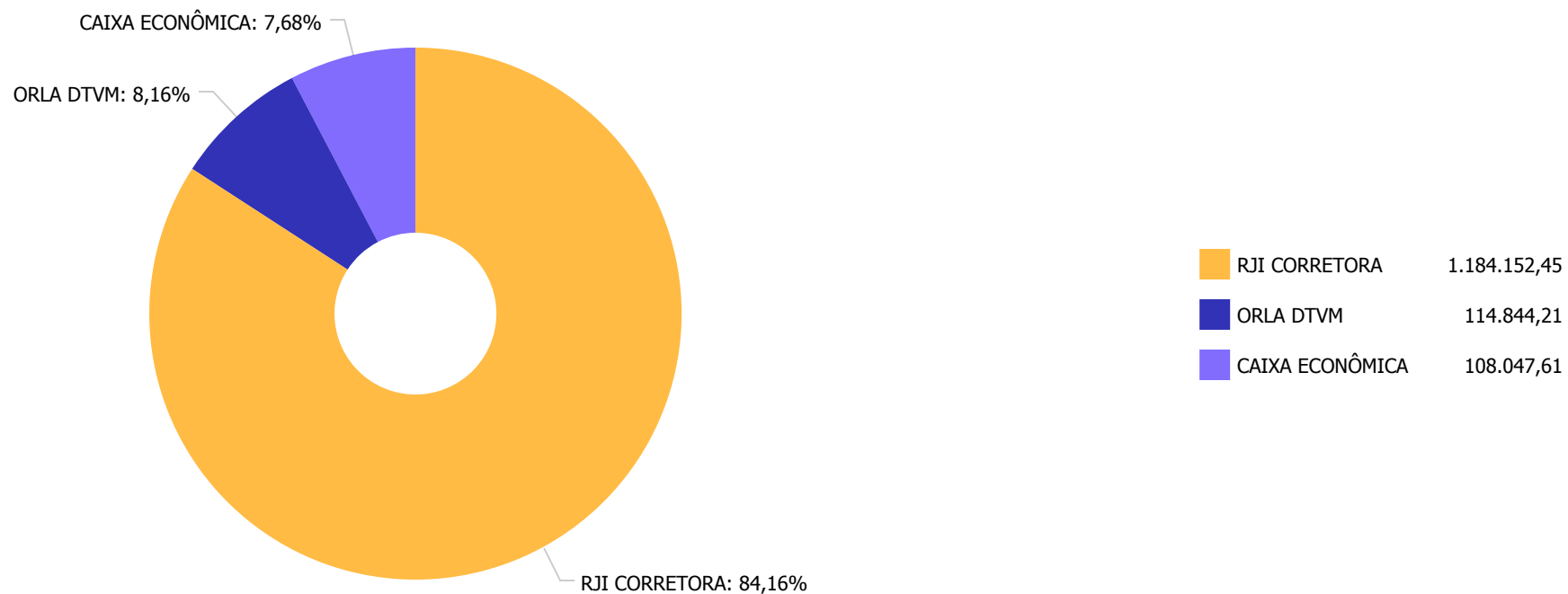
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	94.009,38	6,68	20,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.198.190,68	85,16	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	114.844,21	8,16	0,00	5,00
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	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	2,00	5,00

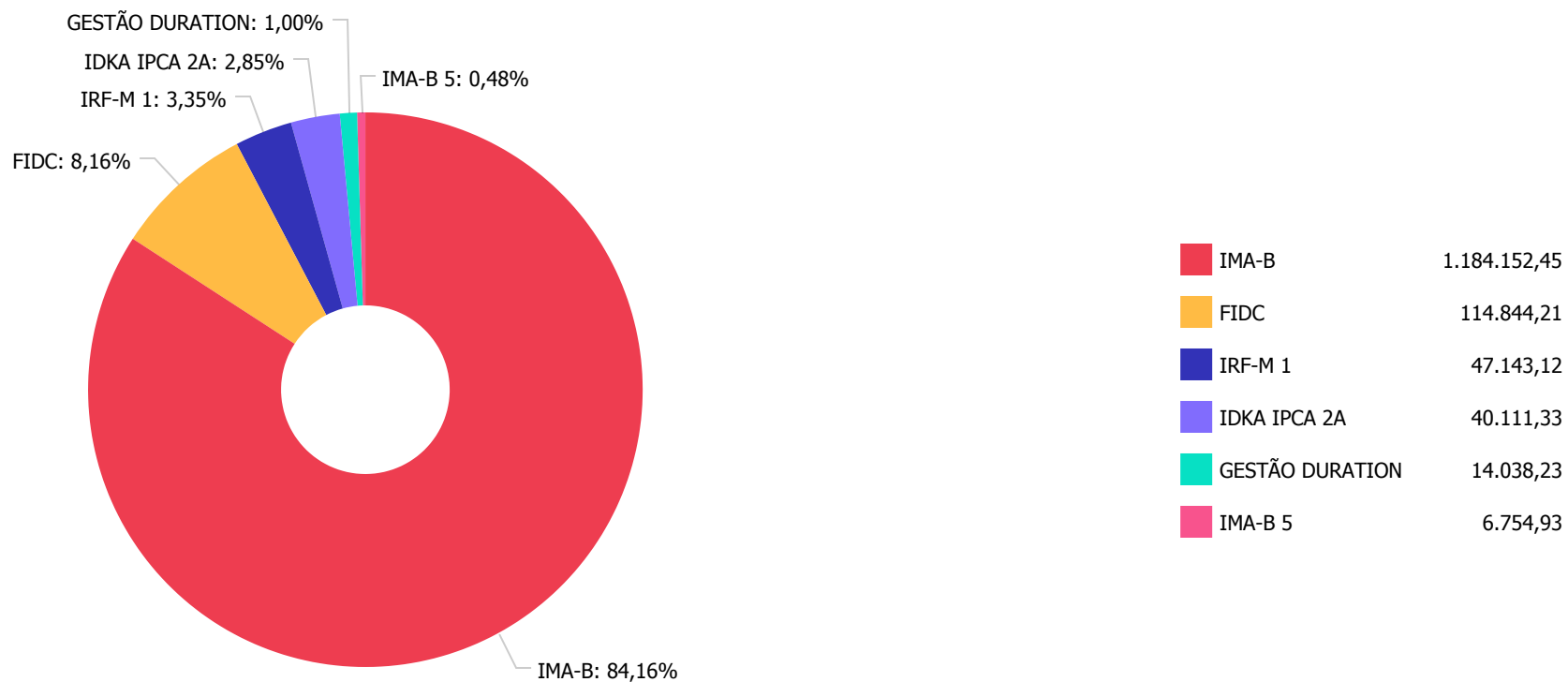
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,26%	1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	1,27%	2,57%	5,93%	9,64%	23,04%	0,01%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	0,91%	1,94%	4,58%	10,98%	22,04%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,85%	0,85%	2,87%	1.854,54%	1.263,34%	-54,29%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,65%	3,62%	6,80%	17,67%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,54%	1,54%	3,07%	6,93%	10,09%	24,15%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,53%	1,53%	3,07%	6,88%	9,91%	23,73%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,05%	14,01%	14,11%	30,65%	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1,87%	1,87%	3,10%	3,57%	2,52%	11,38%	0,01%	0,04%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2019)



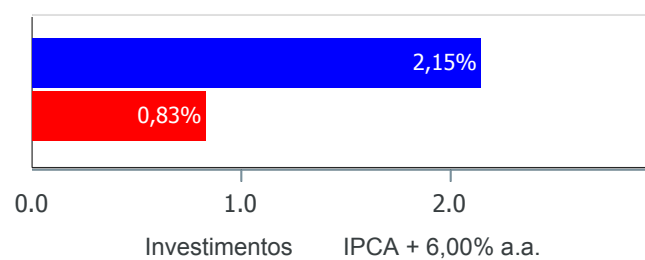
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.509.813,18	0,00	135.228,39	1.407.044,27	32.459,48	32.459,48	2,15%	2,15%	0,83%	0,83%	258,52%	1,40%

Investimentos x Meta Atuarial



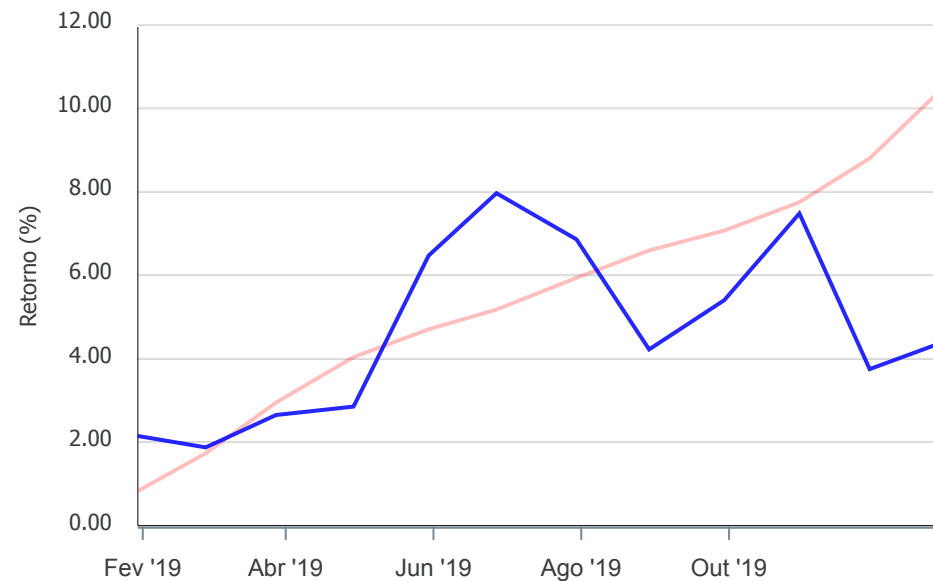
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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/2019**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	34.281,85	0,00	21.000,00	14.038,23	756,38	2,21%	2,88%	1,38%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.162.412,08	0,00	0,00	1.184.152,45	21.740,37	1,87%	1,87%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.652,95	0,00	0,00	6.754,93	101,98	1,53%	1,53%	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	39.609,87	0,00	0,00	40.111,33	501,46	1,27%	1,27%	0,59%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	113.906,73	0,00	0,00	114.844,21	937,48	0,82%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	46.876,90	0,00	0,00	47.143,12	266,22	0,57%	0,57%	0,10%
Total Renda Fixa	1.403.740,38	0,00	21.000,00	1.407.044,27	24.303,89	1,73%		1,40%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2019**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
META VALOR FI AÇÕES	106.072,80	0,00	114.228,39	0,00	8.155,59	7,69%	8,92%	8,17%
Total Renda Variável	106.072,80	0,00	114.228,39	0,00	8.155,59	7,69%		0,00%