

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

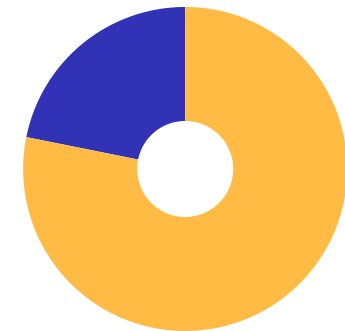
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	4.593.274,91	8,70%	892	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.635.792,04	10,68%	1.004	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.031.219,40	3,85%	1.348	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.470.079,39	8,47%	699	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.195.869,23	9,84%	977	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.817.366,10	5,34%	443	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.118.343,73	5,91%	689	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	3.003.129,25	5,69%	302	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.769.139,18	9,03%	271	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.801.917,38	5,31%	120	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.823.435,18	5,35%	417	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.795.910,48	3,40%	5.492	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	947.302,69	1,79%	68	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	Não inf...	Não há	1.521.651,58	2,88%	32.279	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.902.478,71	3,60%	121	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	211.198,47	0,40%	727	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.305.784,75	4,37%	13.969	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.848.705,70	5,40%	18.477	0,06%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			52.792.598,17				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			194.996,94				Artigo 6º
		PL Total	52.987.595,11				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	27.861.944,80	52,78%	11,51%	53,54%	71,92%	10.106.491,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	3.003.129,25	5,69%	0,00%	0,00%	20,00%	7.555.390,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	10.394.491,74	19,69%	4,06%	20,32%	40,00%	10.722.547,53
Total Renda Fixa	100,00%	41.259.565,79	78,15%	15,57%	73,86%	131,92%	



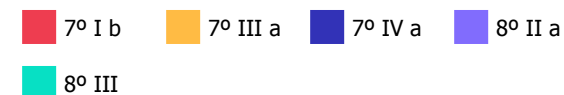
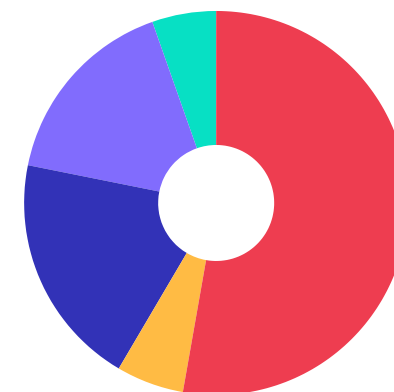
RENDA FIXA 41.259.565,79

RENDA VARIÁVEL 11.533.032,38

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	8.684.326,68	16,45%	3,69%	18,76%	20,00%	1.874.192,95
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.848.705,70	5,40%	3,07%	7,38%	10,00%	2.430.554,12
Total Renda Variável	30,00%	11.533.032,38	21,85%	6,76%	26,14%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.639.629,91
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.639.629,91
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Janeiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.997.789,73	64,40	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.568.760,77	23,81	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	4.323.568,96	8,19	0,00
VINCI PARTNERS	1.902.478,71	3,60	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 - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	27.861.944,80	52,78	11,51	71,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	3.003.129,25	5,69	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	10.394.491,74	19,69	4,06	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	8.684.326,68	16,45	18,45	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.848.705,70	5,40	3,07	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,13%	3,03%	4,04%	7,68%	18,78%	1,02%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,53%	0,90%	3,22%	9,83%	0,15%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	3,22%	3,64%	7,25%	19,86%	1,04%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	1,04%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,86%	-0,86%	5,93%	2,59%	4,73%	23,34%	2,59%	0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,88%	-0,88%	5,95%	2,59%	4,88%	23,40%	2,57%	0,11%
IRF-M (Benchmark)	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,15%	4,92%	16,95%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,30%	4,65%	16,40%	1,53%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,77%	-0,77%	1,51%	-0,25%	4,73%	16,38%	1,53%	0,03%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,76%	0,02%

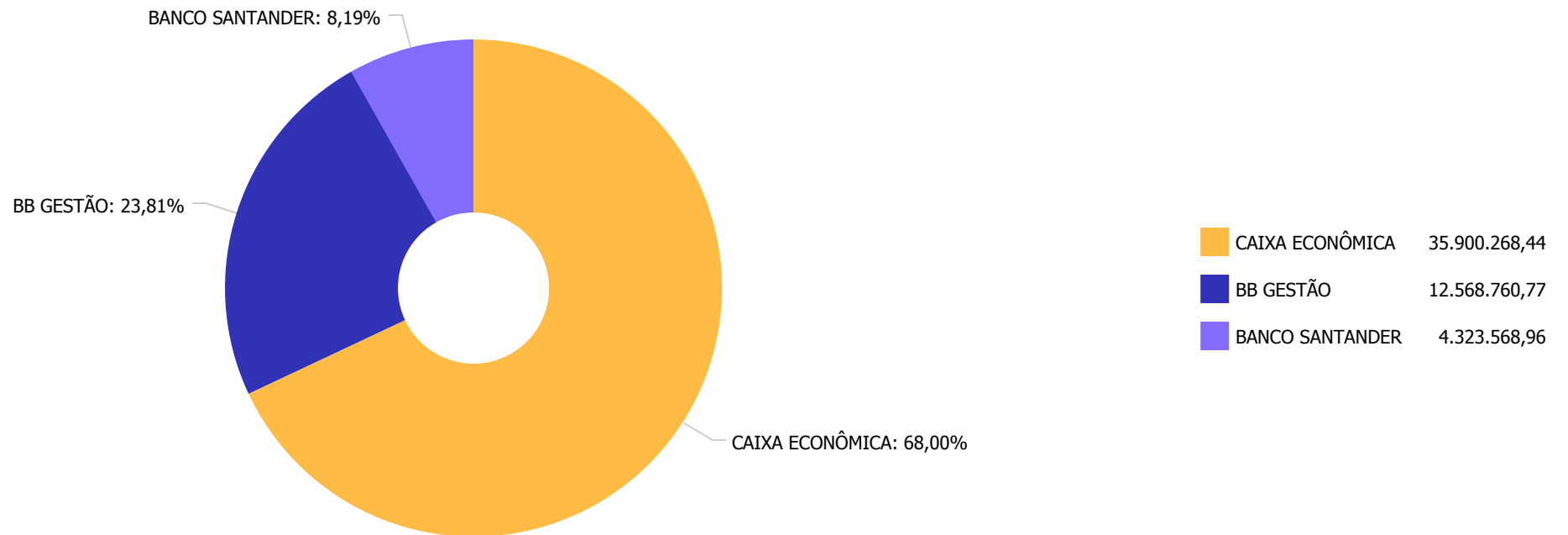
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,78%	0,20%	2,38%	14,58%	0,24%	0,01%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	0,20%	0,55%	0,63%	2,27%	8,16%	0,03%	0,00%

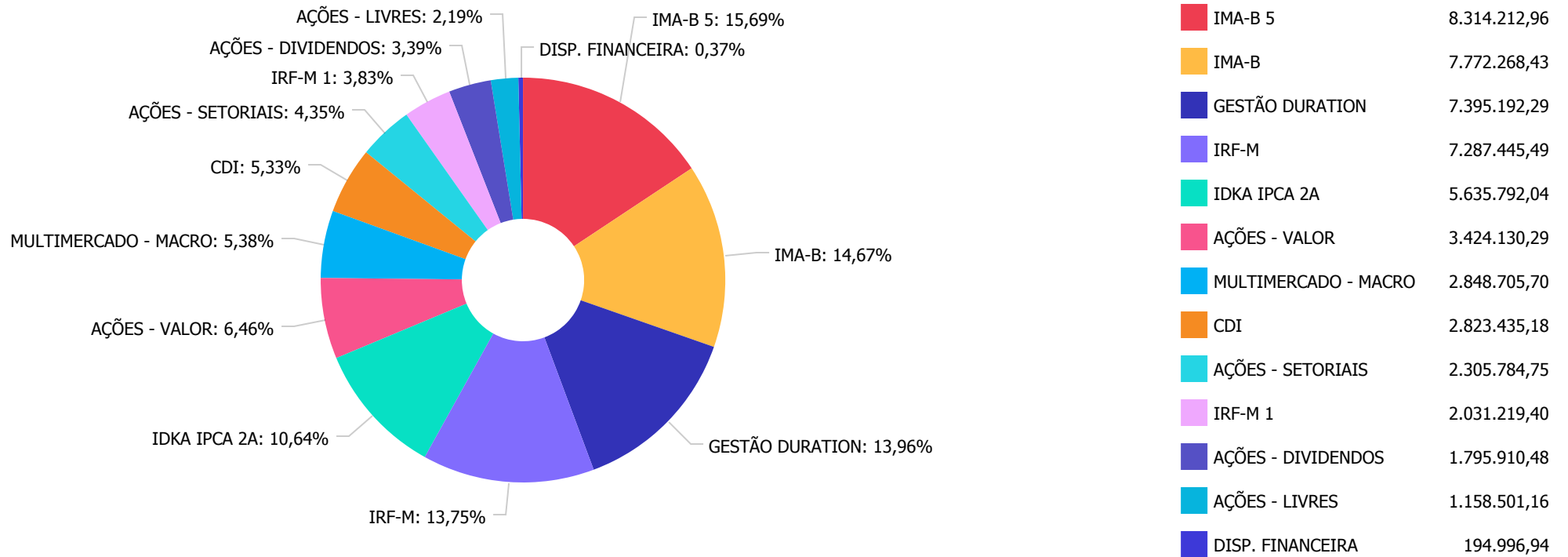
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ICON (Benchmark)	-1,28%	-1,28%	12,91%	3,78%	-3,99%	37,57%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-1,38%	-1,38%	12,38%	2,94%	-5,14%	35,42%	14,59%	0,43%
Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-3,64%	-3,64%	21,73%	11,61%	-4,05%	14,63%	11,45%	0,43%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	-3,03%	-3,03%	17,56%	8,35%	-8,33%	10,98%	11,67%	0,44%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,09%	-0,09%	4,50%	3,05%	2,72%	17,79%	1,73%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,14%	-3,14%	19,35%	8,34%	-2,73%	31,72%	11,99%	0,42%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,19%	-6,19%	17,34%	5,87%	-14,00%	9,17%	10,28%	0,39%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-3,56%	-3,56%	14,87%	8,21%	-2,16%	-	9,94%	0,40%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2021)



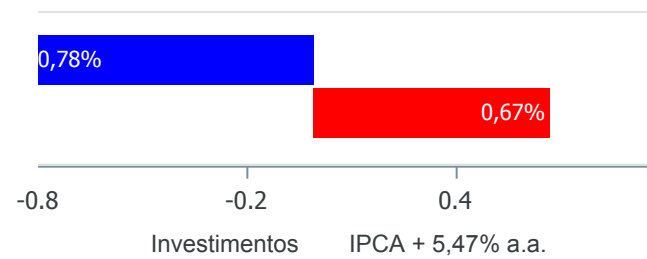
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

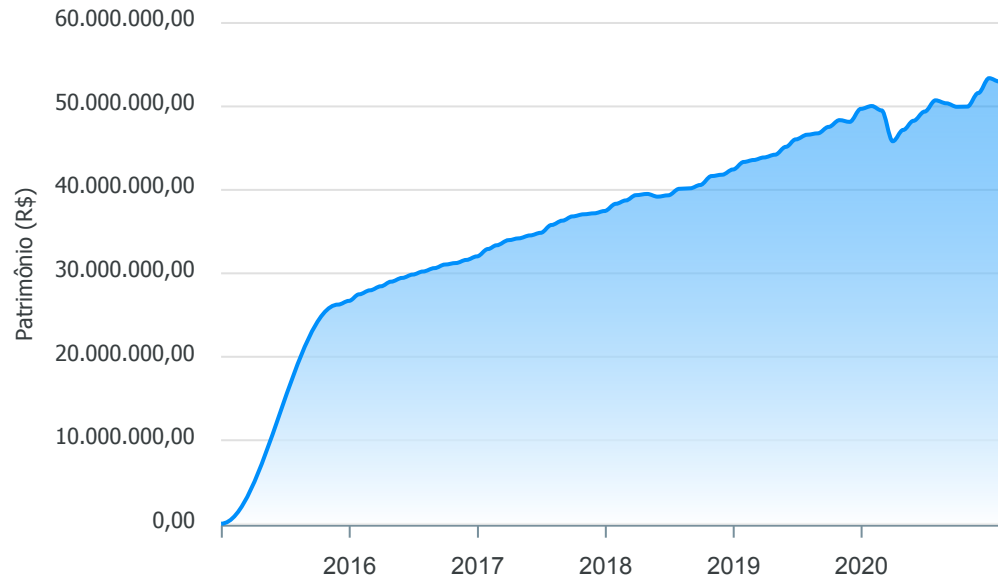
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	53.087.667,04	5.120.000,00	5.000.000,00	52.792.598,17	-415.068,87	-415.068,87	-0,78%	-0,78%	0,67%	0,67%	-115,63%	3,02%

Investimentos x Meta Atuarial



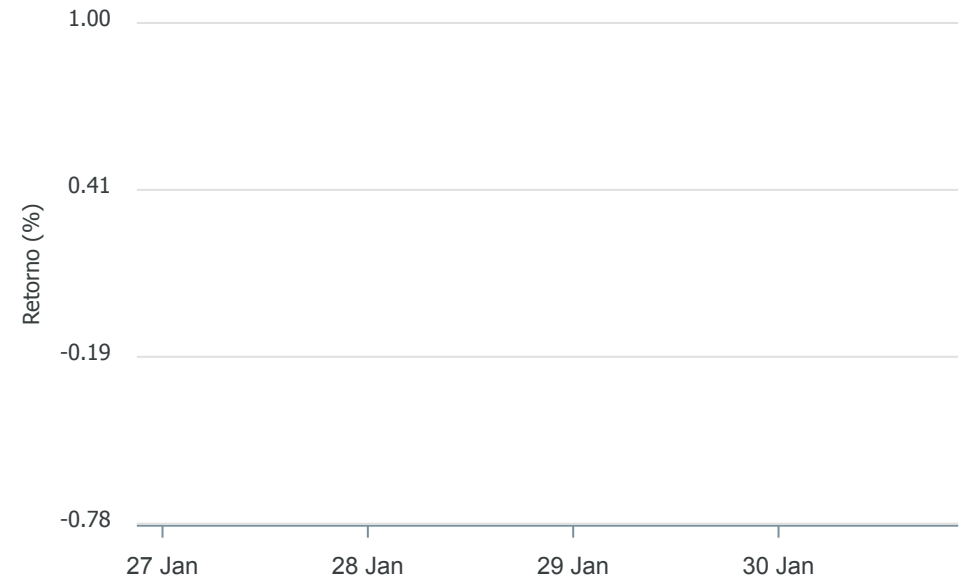
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.817.773,19	0,00	0,00	2.823.435,18	5.661,99	0,20%	0,20%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.628.271,77	0,00	0,00	5.635.792,04	7.520,27	0,13%	0,13%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.615.524,66	1.500.000,00	0,00	3.118.343,73	2.819,07	0,09%	0,10%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.191.547,27	0,00	0,00	5.195.869,23	4.321,96	0,08%	0,08%	1,04%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.801.036,85	0,00	0,00	2.801.917,38	880,53	0,03%	0,03%	0,24%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.592.113,51	0,00	0,00	4.593.274,91	1.161,40	0,03%	0,03%	0,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.030.707,25	0,00	0,00	2.031.219,40	512,15	0,03%	0,03%	0,15%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.782.727,55	2.000.000,00	0,00	4.769.139,18	-13.588,37	-0,28%	-0,86%	2,59%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.868.054,41	1.620.000,00	0,00	4.470.079,39	-17.975,02	-0,40%	-0,80%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.839.260,06	0,00	0,00	2.817.366,10	-21.893,96	-0,77%	-0,77%	1,53%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	8.082.137,87	0,00	5.000.000,00	3.003.129,25	-79.008,62	-0,98%	-0,88%	2,57%
Total Renda Fixa	41.249.154,39	5.120.000,00	5.000.000,00	41.259.565,79	-109.588,60	-0,26%		1,22%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

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	2.851.223,92	0,00	0,00	2.848.705,70	-2.518,22	-0,09%	-0,09%	1,73%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.337.921,90	0,00	0,00	2.305.784,75	-32.137,15	-1,37%	-1,37%	14,59%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	1.569.237,53	0,00	0,00	1.521.651,58	-47.585,95	-3,03%	-3,03%	11,67%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.964.161,42	0,00	0,00	1.902.478,71	-61.682,71	-3,14%	-3,14%	11,99%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	982.303,02	0,00	0,00	947.302,69	-35.000,33	-3,56%	-3,56%	9,94%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	219.179,23	0,00	0,00	211.198,47	-7.980,76	-3,64%	-3,64%	11,45%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.914.485,63	0,00	0,00	1.795.910,48	-118.575,15	-6,19%	-6,19%	10,28%
Total Renda Variável	11.838.512,65	0,00	0,00	11.533.032,38	-305.480,27	-2,58%		9,49%