

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2022



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.633.508,49	19,46%	941	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.201.991,09	17,97%	1.059	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.753.615,43	19,87%	1.021	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.734.331,59	9,44%	1.237	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.192.772,46	11,03%	881	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.254.802,46	4,33%	152	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	541.558,61	1,87%	3.913	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	491.433,55	1,70%	9.958	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.518.046,05	5,24%	531	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	943.311,08	3,26%	12.763	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.005.669,74	3,47%	3.269	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	679.476,43	2,35%	12.029	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		22.176,72	0,08%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			28.950.516,98				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			22.176,72				Artigo 6º
PL Total			28.972.693,70				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2022** não está cadastrada !!!

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	28.950.516,98	100,00	-

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 - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	3,17%	3,14%	4,54%	12,58%	1,11%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	0,61%	2,25%	2,44%	3,30%	6,63%	0,37%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	0,09%	3,35%	3,20%	4,32%	11,89%	0,99%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	0,79%	2,18%	3,74%	5,25%	7,57%	0,05%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%

IDIV (Benchmark)	7,47%	7,47%	10,17%	0,27%	5,96%	1,18%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,24%	7,24%	9,75%	-1,14%	3,63%	-10,88%	6,63%	0,17%

Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,40%	1,40%	6,70%	-6,33%	11,05%	8,65%	8,46%	0,18%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3,98%	3,98%	4,88%	-18,40%	-10,73%	-17,03%	15,73%	0,20%

CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,27%	1,27%	3,05%	-0,01%	2,83%	5,63%	1,39%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,67%	2,67%	4,10%	0,38%	2,42%	4,66%	2,40%	0,05%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1,03%	1,03%	2,36%	3,80%	5,01%	8,14%	0,26%	0,01%

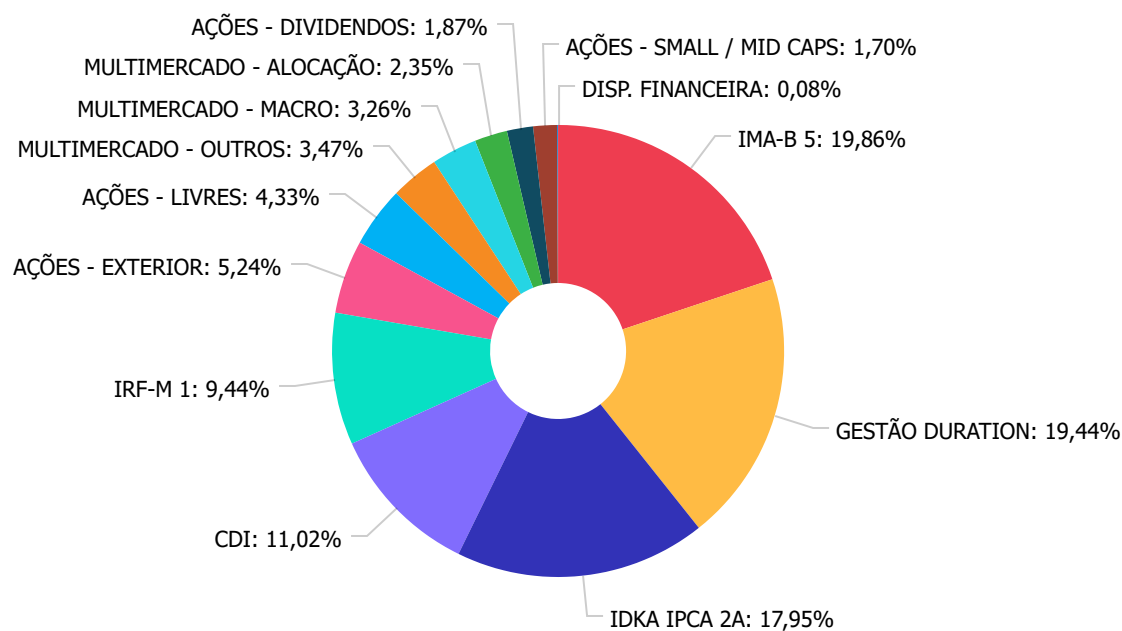
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2022)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2022)

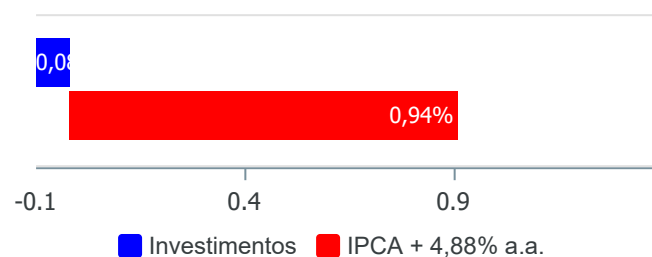


IMA-B 5	5.753.615,43
GESTÃO DURATION	5.633.508,49
IDKA IPCA 2A	5.201.991,09
CDI	3.192.772,46
IRF-M 1	2.734.331,59
AÇÕES - EXTERIOR	1.518.046,05
AÇÕES - LIVRES	1.254.802,46
MULTIMERCADO - OUTROS	1.005.669,74
MULTIMERCADO - MACRO	943.311,08
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	679.476,43
AÇÕES - DIVIDENDOS	541.558,61
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	491.433,55
DISP. FINANCEIRA	22.176,72

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	29.213.369,28	7.037.403,88	7.275.798,12	28.950.516,98	-24.458,06	-24.458,06	-0,08%	-0,08%	0,94%	0,94%	-8,91%	1,92%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



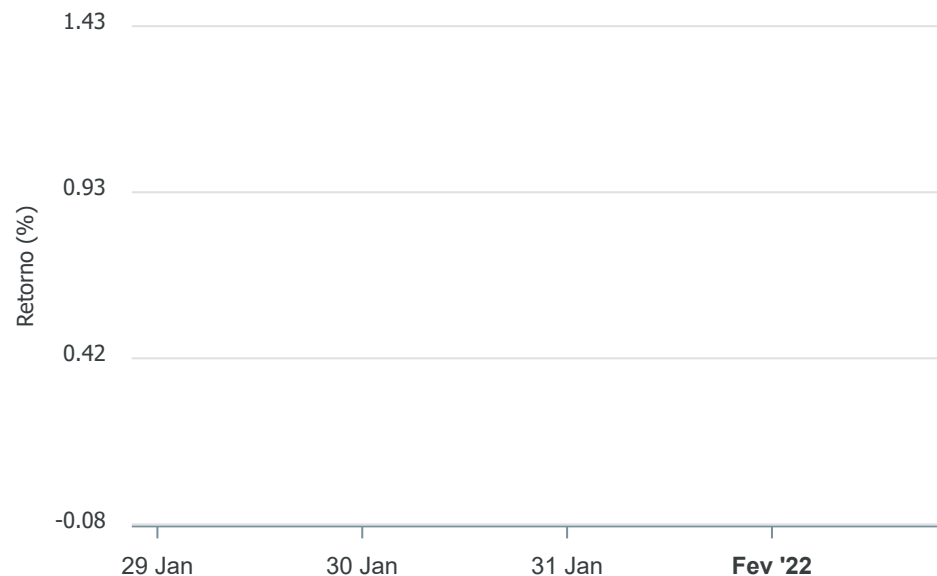
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade 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/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.063.615,93	534.290,38	0,00	5.633.508,49	35.602,18	0,64%	0,67%	0,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.850.406,13	0,00	2.139.623,32	2.734.331,59	23.548,78	0,49%	0,61%	0,37%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.179.160,13	0,00	3.192.772,46	13.612,33	0,43%	0,79%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.323.732,34	1.423.953,37	0,00	5.753.615,43	5.929,72	0,10%	0,09%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.201.012,64	0,00	0,00	5.201.991,09	978,45	0,02%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.831.379,30	0,00	1.823.988,48	0,00	-7.390,82	-0,40%	-0,07%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.717.163,40	0,00	1.694.378,93	0,00	-22.784,47	-1,33%	-0,76%	2,01%
Total Renda Fixa	22.987.309,74	5.137.403,88	5.657.990,73	22.516.219,06	49.496,17	0,22%		0,65%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	505.007,91	0,00	0,00	541.558,61	36.550,70	7,24%	7,24%	6,63%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	472.626,92	0,00	0,00	491.433,55	18.806,63	3,98%	3,98%	15,73%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	661.795,52	0,00	0,00	679.476,43	17.680,91	2,67%	2,67%	2,40%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	722.810,44	500.000,00	0,00	1.254.802,46	31.992,02	2,62%	1,40%	8,46%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	534.064,04	400.000,00	0,00	943.311,08	9.247,04	0,99%	1,27%	1,39%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.005.669,74	5.669,74	0,57%	1,03%	0,26%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	878.273,39	0,00	867.807,39	0,00	-10.466,00	-1,19%	-5,30%	8,59%
Total Renda Variável	3.774.578,22	1.900.000,00	867.807,39	4.916.251,87	109.481,04	2,28%		5,11%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2022)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.451.481,32	0,00	750.000,00	1.518.046,05	-183.435,27	-7,48%	-9,75%	10,47%
Total Exterior	2.451.481,32	0,00	750.000,00	1.518.046,05	-183.435,27	-7,48%		10,47%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.