

Relatório Analítico dos Investimentos

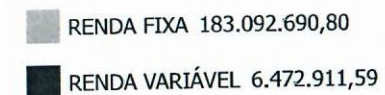
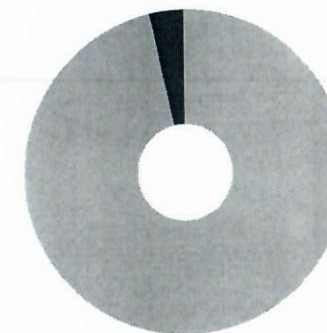
em julho de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	5.533.684,77	2,92%	131	0,69%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			189.565.602,39				

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

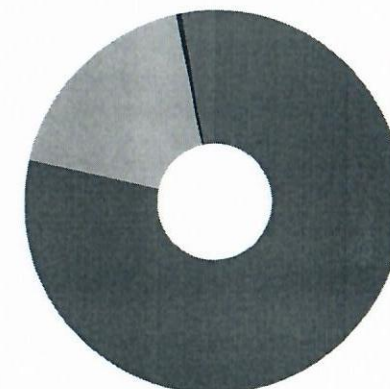
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	148.815.343,07	78,50%	20,00%	50,00%	100,00%	40.750.259,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	34.277.347,73	18,08%	10,00%	30,00%	60,00%	79.462.013,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	9.478.280,12
Total Renda Fixa	100,00%	183.092.690,80	96,59%	30,00%	85,00%	165,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	939.226,82	0,50%	0,00%	10,00%	10,00%	18.017.333,42
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.533.684,77	2,92%	0,00%	10,00%	10,00%	13.422.875,47
Total Renda Variável	30,00%	6.472.911,59	3,41%	0,00%	20,00%	20,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	9.478.280,12
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	9.478.280,12
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	



7º I b 7º III a 8º I 10º I

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	159.057.322,61	83,91	0,54
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.347.062,82	8,10	0,00
SICREDI	15.161.216,96	8,00	0,02

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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 Julho/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,17%	6,66%	1,15%	6,61%	10,11%	16,59%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	6,10%	0,78%	6,08%	9,41%	15,38%	1,48%	0,04%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,20%	1,94%	1,68%	2,45%	1,01%	-2,37%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	1,77%	1,57%	2,32%	0,67%	-2,96%	2,32%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,84%	0,16%	-1,79%	1,79%	-3,22%	-2,89%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91%	0,00%	-1,88%	1,65%	-3,73%	-3,54%	3,99%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,05%	6,09%	2,96%	5,43%	8,11%	10,26%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1,07%	6,23%	3,01%	5,46%	8,48%	10,14%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	5,94%	2,90%	5,30%	7,87%	9,75%	0,25%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,01%	6,62%	1,13%	6,50%	10,04%	15,61%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,33%	2,94%	0,78%	2,97%	3,22%	1,24%	1,51%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,33%	2,93%	0,78%	2,96%	3,22%	1,26%	1,51%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	6,53%	1,12%	6,44%	9,84%	15,08%	1,21%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,88%	3,43%	-0,28%	4,20%	3,25%	5,86%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,15%	0,55%	-0,10%	1,49%	-1,70%	-5,59%	2,99%	0,08%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,90%	3,27%	-0,26%	4,07%	2,97%	5,30%	2,49%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,93%	3,29%	-0,35%	4,08%	2,97%	5,33%	2,47%	0,06%

Selic (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01%	6,30%	3,06%	5,52%	9,17%	11,45%	0,01%	0,01%

CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,02%	6,35%	3,05%	5,60%	9,14%	11,44%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	6,60%	3,15%	5,76%	9,53%	11,70%	0,02%	0,01%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,03%	6,48%	3,13%	5,68%	9,42%	11,89%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,01%	6,66%	3,18%	5,83%	9,79%	12,43%	0,03%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,90%	5,54%	2,69%	4,90%	7,81%	9,49%	0,00%	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08%	6,85%	3,29%	6,03%	10,11%	12,91%	0,01%	0,01%

IPCA (Benchmark)	-0,68%	4,77%	0,46%	4,21%	10,07%	19,97%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,41%	2,09%	4,71%	5,36%	6,31%	0,99%	0,03%



**CRÉDITO
& MERCADO**

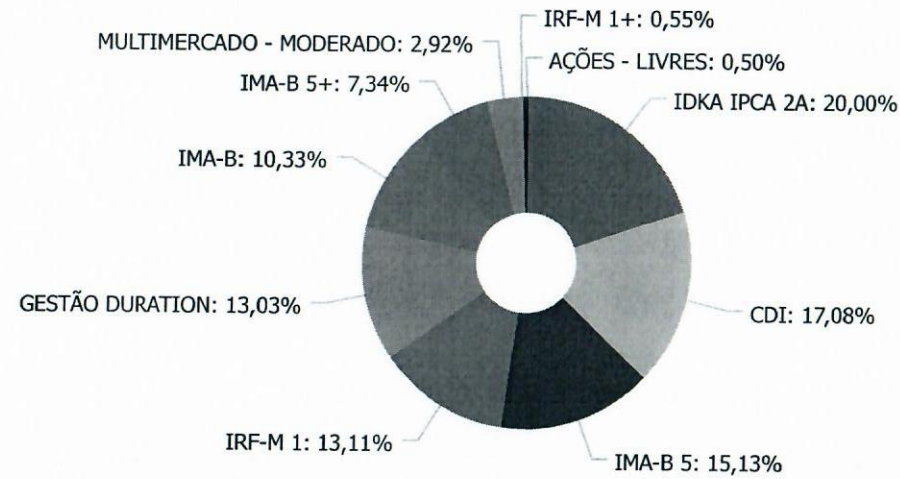
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	4,69%	-1,58%	-4,37%	-8,01%	-15,30%	0,25%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,11%	-3,39%	-4,45%	-8,61%	-20,44%	-11,35%	7,37%	0,20%

CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,72%	5,34%	0,87%	3,86%	4,80%	10,19%	2,10%	0,04%



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



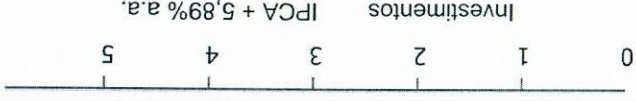
■ IDKA IPCA 2A	37.920.731,00	■ CDI	32.370.159,93	■ IMA-B 5	28.676.350,84	■ IRF-M 1	24.857.727,17
■ GESTÃO DURATION	24.709.480,46	■ IMA-B	19.588.146,11	■ IMA-B 5+	13.918.780,17	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.533.684,77
■ IRF-M 1+	1.051.315,12	■ AÇÕES - LIVRES	939.226,82				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VAR
Jan	175.997.899,26	2.053.612,01	2.897.802,54	175.228.311,28	74.602,55	74.602,55	0,04%	1,02%	1,02%	4,15%	1,28%
Fev	175.228.311,28	5.010.387,20	4.019.955,77	177.536.150,96	1.317.408,25	1.392.010,80	0,75%	1,26%	2,29%	34,48%	1,50%
Mar	177.536.150,96	11.931.193,40	10.338.808,85	182.566.505,59	3.437.970,08	4.829.980,88	1,92%	2,72%	0,00%	-	1,36%
Abr	182.566.505,59	3.965.894,16	3.921.321,00	184.280.626,42	1.669.547,67	6.499.528,55	0,91%	3,66%	0,00%	-	1,11%
Mai	184.280.626,42	20.914.762,33	20.118.745,03	186.804.470,69	1.727.826,97	8.227.355,52	0,93%	4,63%	0,00%	-	1,19%
Jun	186.804.470,69	21.490.280,72	20.546.648,22	188.241.968,02	493.864,83	8.721.220,35	0,26%	4,91%	0,00%	-	1,23%
Jul	188.241.968,02	4.433.086,34	3.552.744,28	189.565.602,39	443.292,31	9.164.512,66	0,23%	5,15%	0,00%	-	1,21%

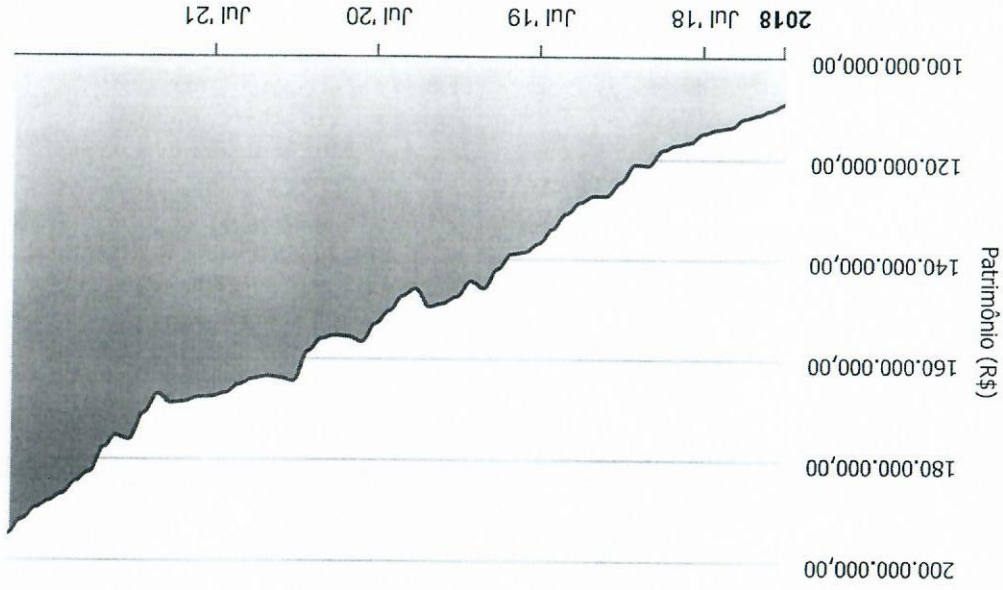
Investimentos x Meta de Rentabilidade

5,15%

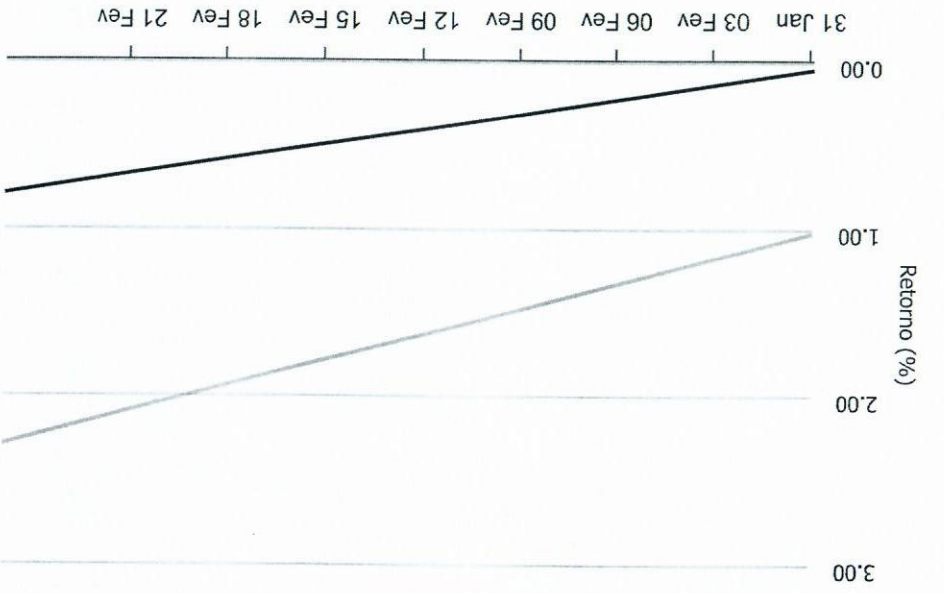




Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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

36M

ANO



Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instil	Var - Mês
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.599.419,69	0,00	7.681.298,15	81.878,46	1,08%	1,08%		0,01%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	7.500.000,00	0,00	7.580.441,78	80.441,78	1,07%	1,07%		0,20%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	7.503.614,07	0,00	7.580.775,18	77.161,11	1,03%	1,03%		0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.820.829,20	0,00	2.849.660,31	28.831,11	1,02%	1,02%		0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.746.413,35	0,00	2.774.308,87	27.895,52	1,02%	1,02%		0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	7.588.843,04	0,00	7.665.764,67	76.921,63	1,01%	1,01%		0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.425.246,09	0,00	3.459.734,63	34.488,54	1,01%	1,01%		0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.806.386,19	2.300.000,00	17.277.285,39	170.899,20	1,00%	1,03%		0,25%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	24.516.752,86	0,00	24.709.480,46	192.727,60	0,79%	0,79%		0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.040.518,21	0,00	1.051.315,12	10.796,91	0,53%	1,15%		2,32%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	771.245,11	2.133.086,34	358.618,12	7.030,95	0,24%	0,90%		0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	28.670.421,66	0,00	28.676.350,84	5.929,18	0,02%	0,02%		1,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	38.031.958,70	0,00	37.920.731,00	-111.227,70	-0,29%	-0,29%		1,48%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.335.326,00	0,00	5.317.915,95	-17.410,05	-0,33%	-0,33%		1,51%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.196.780,00	0,00	3.186.300,00	-10.480,00	-0,33%	-0,33%		1,51%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	2.372.357,11	0,00	2.351.128,81	-21.228,30	-0,89%	-0,89%		2,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.814.318,69	0,00	8.732.801,35	-81.517,34	-0,92%	-0,92%		2,47%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	9.769.638,00	0,00	9.657.240,96	-112.397,04	-1,15%	-1,15%		2,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.344.325,15	0,00	4.261.539,21	-82.785,94	-1,91%	-1,91%		3,99%
Total Renda Fixa	181.854.393,12	4.433.086,34	3.552.744,28	183.092.690,80	357.955,62	0,20%		1,15%