

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2024



Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	815.520,90	12,49%	253	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	708.762,24	10,86%	638	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.568.598,41	24,03%	741	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	363.474,50	5,57%	826	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	494.813,85	7,58%	621	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	427.564,22	6,55%	1.130	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	481.039,83	7,37%	338	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	668.825,01	10,25%	740	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	580.230,36	8,89%	1.144	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	333.683,76	5,11%	554	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	69.236,03	1,06%	16.276	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	15.136,79	0,23%	37	0,03%	Artigo 8º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			6.526.885,90				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			79.606,78	Artigo 6º			
PL Total			6.606.492,68				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	5.528.598,96	84,71%	0,00%	45,00%	0,00%	-5.528.598,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	913.914,12	14,00%	0,00%	20,00%	0,00%	-913.914,12
Total Renda Fixa	100,00%	6.442.513,08	98,71%	0,00%	80,00%	0,00%	

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	69.236,03	1,06%	0,00%	5,00%	0,00%	-69.236,03
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	15.136,79	0,23%	0,00%	7,00%	0,00%	-15.136,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	0,00%	0,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	84.372,82	1,29%	0,00%	15,00%	0,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	6.526.885,90	100,00	0,03

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 Dezembro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,24%	5,84%	0,79%	2,55%	5,84%	18,67%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	5,43%	0,67%	2,41%	5,43%	17,98%	2,40%	2,35%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,70%	9,46%	2,13%	4,74%	9,46%	23,96%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69%	9,33%	2,08%	4,64%	9,33%	23,57%	0,23%	0,45%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,28%	6,16%	0,82%	2,75%	6,16%	19,03%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,31%	5,92%	0,75%	2,63%	5,92%	18,59%	2,25%	2,11%
IMA-B (Benchmark)	-2,62%	-2,44%	-3,23%	-1,36%	-2,44%	13,22%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,66%	-2,72%	-3,33%	-1,51%	-2,72%	12,71%	4,62%	4,66%
IRF-M (Benchmark)	-1,66%	1,86%	-1,97%	0,34%	1,86%	18,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,69%	1,59%	-2,03%	0,22%	1,59%	18,17%	2,99%	3,22%
CDI (Benchmark)	0,93%	10,87%	2,67%	5,37%	10,87%	25,34%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,83%	10,87%	2,58%	5,35%	10,87%	25,70%	0,06%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83%	11,03%	2,57%	5,38%	11,03%	25,82%	0,06%	0,06%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,91%	10,61%	2,61%	5,25%	10,61%	24,76%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	10,61%	2,64%	5,35%	10,61%	24,97%	0,05%	0,10%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,52%	4,83%	1,48%	2,29%	4,83%	9,68%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,20%	6,26%	1,60%	3,81%	6,26%	20,70%	1,18%	1,41%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,28%	-10,36%	-8,75%	-2,92%	-10,36%	9,61%	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-4,13%	-10,05%	-8,52%	-2,77%	-10,05%	9,37%	8,60%	12,62%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	-0,81%	20,80%	7,19%	6,56%	20,80%	101,17%	10,11%	26,97%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2024)

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2024)

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	5.430.867,70	115.000,00	71.925,71	5.516.314,63	42.372,64	42.372,64	0,77%	0,77%	0,84%	0,84%	92,22%	0,51%
Fevereiro	5.516.314,63	120.000,00	74.200,00	5.595.530,18	33.415,55	75.788,19	0,60%	1,38%	1,19%	2,04%	67,52%	0,48%
Março	5.595.530,18	159.324,02	118.408,73	5.673.160,95	36.715,48	112.503,67	0,65%	2,04%	0,54%	2,59%	78,63%	0,59%
Abril	5.673.160,95	226.824,02	125.592,18	5.785.823,61	11.430,82	123.934,49	0,20%	2,24%	0,80%	3,41%	65,66%	0,86%
Maiο	5.785.823,61	129.462,00	80.668,79	5.883.515,88	48.899,06	172.833,55	0,84%	3,10%	0,86%	4,30%	71,99%	0,66%
Junho	5.883.515,88	125.000,00	63.510,52	5.964.011,45	19.006,09	191.839,64	0,32%	3,43%	0,59%	4,92%	69,68%	0,85%
Julho	5.964.011,45	156.924,02	116.844,58	6.064.705,27	60.614,38	252.454,02	1,01%	4,47%	0,82%	5,78%	77,40%	0,82%
Agosto	6.064.705,27	117.000,00	90.722,05	6.139.511,39	48.528,17	300.982,19	0,80%	5,30%	0,40%	6,20%	85,57%	1,06%
Setembro	6.139.511,39	146.000,00	79.988,44	6.229.039,97	23.517,02	324.499,21	0,38%	5,70%	0,84%	7,09%	80,43%	0,73%
Outubro	6.229.039,97	152.000,00	86.660,69	6.335.013,22	40.633,94	365.133,15	0,65%	6,39%	1,00%	8,16%	78,25%	0,71%
Novembro	6.335.013,22	258.872,06	196.633,09	6.428.169,99	30.917,80	396.050,95	0,48%	6,90%	0,75%	8,98%	76,89%	0,93%
Dezembro	6.428.169,99	115.400,00	12.377,56	6.526.885,90	-4.306,53	391.744,42	-0,07%	6,83%	0,92%	9,98%	68,45%	1,56%

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

☒ Investimentos

☒ Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B

ANO

36M

☐ 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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	750.745,35	57.700,00	0,00	815.520,90	7.075,55	0,88%	0,91%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	663.148,38	0,00	0,00	668.825,01	5.676,63	0,86%	0,86%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	575.461,59	0,00	0,00	580.230,36	4.768,77	0,83%	0,83%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	273.520,45	57.700,00	0,00	333.683,76	2.463,31	0,74%	0,83%	0,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	436.947,08	0,00	12.377,56	427.564,22	2.994,70	0,69%	0,69%	0,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	707.368,67	0,00	0,00	708.762,24	1.393,57	0,20%	0,20%	1,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.573.137,99	0,00	0,00	1.568.598,41	-4.539,58	-0,29%	-0,29%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	364.600,24	0,00	0,00	363.474,50	-1.125,74	-0,31%	-0,31%	2,25%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	489.306,04	0,00	0,00	481.039,83	-8.266,21	-1,69%	-1,69%	2,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	508.346,74	0,00	0,00	494.813,85	-13.532,89			