

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2018

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2018)

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	46.876,90	3,10%	1.477	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.652,95	0,44%	724	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	39.609,87	2,62%	732	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.162.412,08	76,99%	1	3,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	34.281,85	2,27%	345	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	113.906,73	7,54%	70	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	106.072,80	7,03%	173	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.509.813,18				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2018)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	93.139,72	6,17%	15,00%	25,00%	70,00%	963.729,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	905.887,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.196.693,93	79,26%	5,00%	10,00%	30,00%	-743.749,98
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	226.471,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	113.906,73	7,54%	1,00%	5,00%	5,00%	-38.416,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	75.490,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	75.490,66
Total Renda Fixa	100,00%	1.403.740,38	92,97%	26,00%	70,00%	190,00%	

JavaScript chart by amCharts 3.20.20

 JavaScript chart by amCharts 3.20.20
 RENDA FIXA 1.403.740,38 RENDA VARIÁVEL 106.072,80

☐ **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 (Dezembro / 2018)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	150.981,32
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	106.072,80	7,03%	0,00%	5,00%	10,00%	44.908,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	150.981,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	75.490,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	75.490,66
Total Renda Variável	30,00%	106.072,80	7,03%	0,00%	30,00%	40,00%	

JavaScript chart by amCharts 3.20.20

 JavaScript chart by amCharts 3.20.207 I b7º IV a7º VII a8º II
 a

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2018)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.162.412,08	76,99	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	127.421,57	8,44	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	113.906,73	7,54	0,15
META ASSET MANAGEMENT	106.072,80	7,03	0,05

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 - 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	93.139,72	6,17	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.196.693,93	79,26	5,00	30,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	113.906,73	7,54	1,00	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 I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	106.072,80	7,03	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2018 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,25%	9,75%	3,40%	6,58%	9,75%	24,69%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,16%	9,30%	3,40%	5,85%	9,30%	22,79%	0,00%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,69%	10,95%	2,07%	4,59%	10,95%	22,12%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,34%	1.128,83%	2,01%	-	1.128,83%	-46,78%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,81%	2,02%	3,74%	6,81%	18,48%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,36%	9,87%	4,65%	6,86%	9,87%	23,68%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	9,67%	4,66%	6,81%	9,67%	23,25%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	1,65%	13,06%	9,89%	11,77%	13,06%	27,52%	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	0,36%	3,19%	2,46%	2,65%	3,19%	11,28%	0,02%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2018 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX (Benchmark)	-1,29%	15,42%	11,90%	21,79%	15,42%	47,21%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-0,65%	22,23%	17,74%	24,32%	22,23%	71,35%	0,08%	0,25%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2018)

JavaScript chart by amCharts 3.20.20RJI CORRETORA: 76,99%CAIXA ECONÔMICA: 8,44%ORLA DTVM: 7,54%BANCO DAYCOVAL: 7,03%

JavaScript chart by amCharts 3.20.20RJI
CORRETORA1.162.412,08CAIXA
ECONÔMICA127.421,57ORLA
DTVM113.906,73BANCO
DAYCOVAL106.072,80

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2018)

JavaScript chart by amCharts 3.20.20IMA-B: 76,99%FIDC: 7,54%AÇÕES - VALOR: 7,03%IRF-M 1: 3,10%IDKA IPCA 2A: 2,62%GESTÃO DURATION: 2,27%IMA-B 5: 0,44%

JavaScript chart by amCharts 3.20.20IMA-B
1.162.412,08FIDC113.906,73AÇÕES -
VALOR106.072,80IRF-M 146.876,90IDKA IPCA
2A39.609,87GESTÃO DURATION34.281,85IMA-B
56.652,95

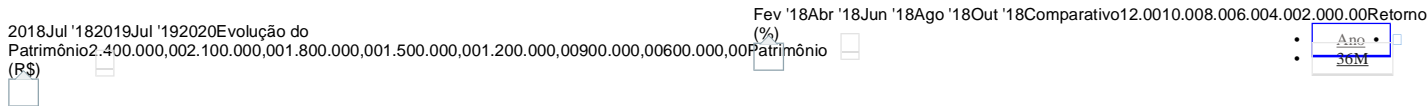
Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	2.165.396,36	33.525,50	80.794,35	2.152.297,59	34.170,08	34.170,08	1,58%	1,58%	0,80%	0,80%	196,89%	0,85%
Fevereiro	2.152.297,59	36.020,47	86.610,65	2.110.796,82	9.089,41	43.259,49	0,42%	2,01%	0,74%	1,55%	129,83%	1,39%
Março	2.110.796,82	87.221,28	138.163,63	2.081.916,15	22.061,68	65.321,17	1,05%	3,07%	0,58%	2,13%	144,15%	1,13%
Abril	2.081.916,15	682.554,01	731.053,95	2.037.057,18	3.640,97	68.962,14	0,17%	3,25%	0,71%	2,85%	113,96%	0,99%
Mai	2.037.057,18	73.732,95	212.349,73	1.852.355,91	-46.084,49	22.877,65	-2,26%	0,92%	0,89%	3,77%	24,34%	1,70%
Junho	1.852.355,91	85.222,64	132.340,49	1.805.230,54	-7,52	22.870,13	0,00%	0,92%	1,75%	5,59%	16,41%	2,81%
Julho	1.805.230,54	93.338,34	146.507,95	1.770.012,57	17.951,64	40.821,77	0,99%	1,92%	0,84%	6,48%	29,66%	1,43%
Agosto	1.770.012,57	34.238,81	93.863,90	1.812.847,66	102.460,18	143.281,95	5,79%	7,82%	0,44%	6,95%	112,56%	2,39%
Setembro	1.812.847,66	92.274,68	144.091,61	1.762.082,18	1.051,45	144.333,40	0,06%	7,88%	0,92%	7,93%	99,35%	1,26%
Outubro	1.762.082,18	234.077,30	296.844,11	1.724.815,59	25.500,22	169.833,62	1,45%	9,44%	0,96%	8,97%	105,25%	2,39%
Novembro	1.724.815,59	34.378,09	92.470,81	1.680.831,80	14.108,93	183.942,55	0,82%	10,34%	0,25%	9,25%	111,80%	2,00%
Dezembro	1.680.831,80	3.117,74	178.896,45	1.509.813,18	4.760,09	188.702,64	0,28%	10,65%	0,61%	9,92%	107,39%	2,28%

963010,65%9,92%Investimentos x Meta Atuarial


 Investimentos
 IPCA + 6,00% a.a.

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores



- Investimentos
- IM-B 5+
- IM-vespa
- IM-3X
- IM-Geral
- IM-ILL
- Met-Atuarial
- DI
- F-M
- IV
- A-B
- A-B 1
- A-B 5
- M 1+

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2018

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.562,49	0,00	0,00	6.652,95	90,46	1,38%	1,38%	0,60%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	33.833,23	0,00	0,00	34.281,85	448,62	1,33%	1,33%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	46.624,04	0,00	0,00	46.876,90	252,86	0,54%	0,54%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	203.735,27	0,00	165.000,00	39.609,87	874,60	0,43%	1,16%	0,42%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.158.237,74	0,00	0,00	1.162.412,08	4.174,34	0,36%	0,36%	1,93%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	10.777,69	3.117,74	13.896,45	0,00	1,02	0,01%	0,09%	0,00%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	114.297,92	0,00	0,00	113.906,73	-391,19	-0,34%	-	-
Total Renda Fixa	1.574.068,38	3.117,74	178.896,45	1.403.740,38	5.450,71	0,35%		1,78%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2018

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
META VALOR FI AÇÕES	106.763,42	0,00	0,00	106.072,80	-690,62	-0,65%	-0,65%	8,41%
Total Renda Variável	106.763,42	0,00	0,00	106.072,80	-690,62	-0,65%		8,41%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2018

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.134.489,72	0,00	0,00	1.162.412,08	27.922,36	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	409.807,88	0,00	378.400,00	39.609,87	8.201,99	2,00%	3,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	33.145,53	0,00	0,00	34.281,85	1.136,32	3,43%	3,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	45.949,33	0,00	0,00	46.876,90	927,57	2,02%	2,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.427,48	0,00	73,00	6.652,95	298,47	4,64%	4,66%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18.119,63	171.573,13	189.738,37	0,00	45,61	0,02%	0,29%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	114.142,61	0,00	0,00	113.906,73	-235,88	-0,21%	2,01%
				Total Renda Fixa	38.296,44	1,98%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2018

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
META VALOR FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	106.072,80	6.072,80	6,07%	17,74%
				Total Renda Variável	6.072,80	6,07%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2018

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9.269,55	0,00	0,00	113.906,73	104.637,18	1.128,83%	1.128,83%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.126.499,45	0,00	0,00	1.162.412,08	35.912,63	3,19%	3,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	914.166,97	0,00	888.438,00	46.876,90	21.147,93	2,31%	6,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.959,62	400.000,00	381.100,00	39.609,87	16.750,25	4,15%	9,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	200.000,00	168.500,00	34.281,85	2.781,85	1,39%	7,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.178,70	0,00	5.223,00	6.652,95	697,25	6,24%	9,67%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	66.557,86	789.701,81	856.641,74	0,00	382,07	0,04%	1,26%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.764,21	0,00	34.084,89	0,00	320,68	0,95%	6,12%
			Total Renda Fixa		182.629,84	5,14%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2018

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
META VALOR FI AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	106.072,80	6.072,80	6,07%	22,23%
			Total Renda Variável		6.072,80	6,07%	

