

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio 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 (Maio / 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 | 100.751,34 | 5,44% | 1.416 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 6.271,69 | 0,34% | 737 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 399.525,82 | 21,57% | 661 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | D+1002 | Não há | 1.134.364,06 | 61,24% | 12 | 3,39% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | D+0 | Não há | 5.241,16 | 0,28% | 15.441 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 198.246,39 | 10,70% | 227 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | D+1260 | 90 dias | 7.955,45 | 0,43% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 1.852.355,91 | | | | |

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2018 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|---------------------|----------------|-------------------------------|---------------|----------------|--------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 506.548,85 | 27,35% | 15,00% | 25,00% | 70,00% | 790.100,29 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 60,00% | 1.111.413,55 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40,00% | 1.337.851,61 | 72,22% | 5,00% | 10,00% | 30,00% | -782.144,84 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,00% | 15,00% | 277.853,39 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00% | 7.955,45 | 0,43% | 1,00% | 5,00% | 5,00% | 84.662,35 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 92.617,80 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 92.617,80 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 1.852.355,91 | 100,00% | 26,00% | 70,00% | 190,00% | |

JavaScript chart by amCharts 3.20.20

JavaScript chart by amCharts 3.20.20
RENDA FIXA 1.852.355,91

☐ **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 (Maio / 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% | 185.235,59 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 185.235,59 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 185.235,59 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 92.617,80 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 92.617,80 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 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 a

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

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|--------------|---------------|----------------|
| VERITAS CAPITAL MANAGEMENT | 1.134.364,06 | 61,24 | - |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 710.036,40 | 38,33 | 0,00 |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA | 7.955,45 | 0,43 | - |

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 ' | 506.548,85 | 27,35 | 15,00 | 70,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 1.337.851,61 | 72,22 | 5,00 | 30,00 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 7.955,45 | 0,43 | 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 ' | 0,00 | 0,00 | 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 Maio/2018 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | -1,02% | 2,81% | 1,39% | 4,00% | 10,66% | 25,09% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,79% | 3,05% | 1,51% | 3,95% | 10,18% | 23,82% | 0,01% | 0,01% |
| IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark) | 0,97% | 4,17% | 2,43% | 5,19% | 9,97% | 21,90% | - | - |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | -9,39% | -14,18% | -46,45% | -37,88% | -96,39% | -97,35% | - | - |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,20% | 2,52% | 1,37% | 3,10% | 8,17% | 22,97% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,19% | 2,45% | 1,32% | 3,03% | 7,99% | 22,55% | 0,00% | 0,00% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | -1,56% | 2,35% | 0,46% | 3,25% | 9,82% | 23,40% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,59% | 2,25% | 0,39% | 3,13% | 9,58% | 22,93% | 0,01% | 0,02% |
| IMA-B (Benchmark) | -3,16% | 1,48% | -2,39% | 2,32% | 8,72% | 25,38% | - | - |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | -3,40% | 0,70% | -2,14% | 1,67% | 5,55% | 18,68% | 0,02% | 0,03% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,10% | 0,56% | 0,31% | 0,71% | 2,48% | 10,42% | 0,00% | 0,00% |

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

JavaScript chart by amCharts 3.20.20RJI CORRETORA: 61,24%CAIXA ECONÔMICA: 38,33%ORLA DTVM: 0,43%

JavaScript chart by amCharts 3.20.20RJI
CORRETORA1.134.364,06CAIXA
ECONÔMICA710.036,40ORLA DTVM7.955,45

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

JavaScript chart by amCharts 3.20.20IMA-B: 61,24%IDKA IPCA 2A: 21,57%GESTÃO DURATION: 10,70%IRF-M 1: 5,44%FIDC: 0,43%IMA-B 5: 0,34%CDI: 0,28%

JavaScript chart by amCharts 3.20.20IMA-B
1.134.364,06IDKA IPCA 2A399.525,82GESTÃO
DURATION198.246,39IRF-M
1100.751,34FIDC7.955,45IMA-B
56.271,69CDI5.241,16

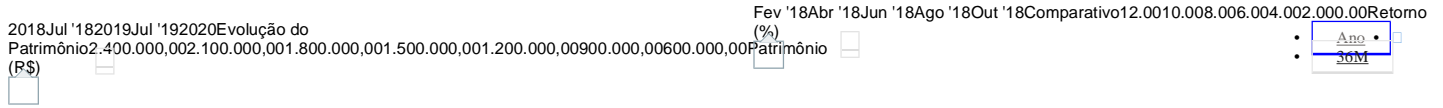
Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018)

| 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% |

32100,92%3,77%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 Maio/2018

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|---------------------|------------------|-------------------|---------------------|-------------------|---------------|------------|--------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 230.460,40 | 0,00 | 130.000,00 | 100.751,34 | 290,94 | 0,13% | 0,19% | 0,29% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 13.812,23 | 73.732,95 | 82.349,73 | 5.241,16 | 45,71 | 0,05% | 0,10% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 402.701,13 | 0,00 | 0,00 | 399.525,82 | -3.175,31 | -0,79% | -0,79% | 1,01% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 200.592,10 | 0,00 | 0,00 | 198.246,39 | -2.345,71 | -1,17% | -1,17% | 1,28% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 6.372,83 | 0,00 | 0,00 | 6.271,69 | -101,14 | -1,59% | -1,59% | 1,31% |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | 1.174.338,16 | 0,00 | 0,00 | 1.134.364,06 | -39.974,10 | -3,40% | -3,40% | 2,16% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 8.780,33 | 0,00 | 0,00 | 7.955,45 | -824,88 | -9,39% | - | - |
| Total Renda Fixa | 2.037.057,18 | 73.732,95 | 212.349,73 | 1.852.355,91 | -46.084,49 | -2,18% | | 1,70% |

