

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em setembro e 3º trimestre 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 (Setembro / 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	45.949,33	2,61%	1.471	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.427,48	0,36%	701	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	409.807,88	23,26%	674	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.134.489,72	64,38%	12	3,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	18.119,63	1,03%	15.658	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	33.145,53	1,88%	310	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	114.142,61	6,48%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>1.762.082,18</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	462.184,69	26,23%	15,00%	25,00%	70,00%	771.272,84
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	1.057.249,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.185.754,88	67,29%	5,00%	10,00%	30,00%	-657.130,23
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	264.312,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	114.142,61	6,48%	1,00%	5,00%	5,00%	-26.038,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	88.104,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	88.104,11
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.762.082,18</b>	<b>100,00%</b>	<b>26,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>190,00%</b>	

JavaScript chart by amCharts 3.20.20

JavaScript chart by amCharts 3.20.20  
RENDA  
FIXA 1.762.082,18

☐ **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 (Setembro / 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%	176.208,22
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	176.208,22
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	176.208,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	88.104,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	88.104,11
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	

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 (Setembro / 2018)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.134.489,72	64,38	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	513.449,85	29,14	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	114.142,61	6,48	0,18

**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 '	462.184,69	26,23	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.185.754,88	67,29	5,00	30,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	114.142,61	6,48	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 Setembro/2018 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	5,71%	2,36%	2,56%	7,66%	21,41%	0,01%	0,02%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,99%	8,69%	2,47%	6,18%	11,75%	22,54%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,00%	1.104,66%	-	1.170,91%	-5,55%	-60,62%	-	-
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	1,69%	2,89%	6,57%	19,83%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	4,79%	2,06%	1,27%	6,28%	20,38%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,36%	0,71%	0,18%	-3,48%	0,79%	10,51%	0,01%	0,04%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,09%	0,97%	0,30%	0,60%	1,51%	7,75%	0,00%	0,00%

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

JavaScript chart by amCharts 3.20.20RJI CORRETORA: 64,38%CAIXA ECONÔMICA: 29,14%ORLA DTVM: 6,48%

JavaScript chart by amCharts 3.20.20RJI  
CORRETORA1.134.489,72CAIXA  
ECONÔMICA513.449,85ORLA DTVM114.142,61

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

JavaScript chart by amCharts 3.20.20IMA-B: 64,38%IDKA IPCA 2A: 23,26%FIDC: 6,48%IRF-M 1: 2,61%GESTÃO DURATION: 1,88%CDI: 1,03%IMA-B 5: 0,36%

JavaScript chart by amCharts 3.20.20IMA-B  
1.134.489,72IDKA IPCA  
2A409.807,88FIDC114.142,61IRF-M  
145.949,33GESTÃO  
DURATION33.145,53CDI118.119,63IMA-B  
56.427,48



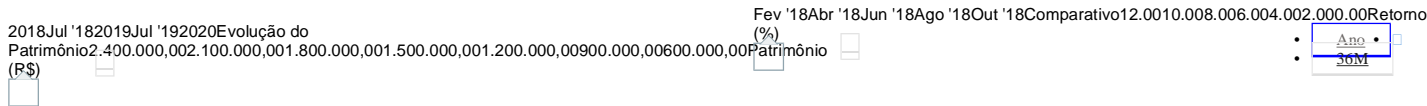
**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018)**

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%

64207,88%7,93%Investimentos x Meta Atuarial


 Investimentos  
 IPCA + 6,00% a.a.

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores



- Investimentos
- IM-B 5+
- IM-Bespa
- IM-Geral
- IM-3X
- IM-LL
- IM-IV
- MetAtuarial
- DI
- DI-A-B
- DI-M 1
- DI-A-B 5
- DI-M 1+

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

## FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	405.139,41	0,00	0,00	409.807,88	4.668,47	1,15%	1,15%	0,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.372,87	0,00	0,00	6.427,48	54,61	0,86%	0,86%	1,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	45.680,40	0,00	0,00	45.949,33	268,93	0,59%	0,59%	0,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	90.153,37	0,00	57.500,00	33.145,53	492,16	0,55%	0,66%	0,55%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	12.400,87	92.274,68	86.591,61	18.119,63	35,69	0,03%	0,09%	0,00%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	114.530,04	0,00	0,00	114.142,61	-387,43	-0,34%	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.138.570,70	0,00	0,00	1.134.489,72	-4.080,98	-0,36%	-0,36%	1,48%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.812.847,66</b>	<b>92.274,68</b>	<b>144.091,61</b>	<b>1.762.082,18</b>	<b>1.051,45</b>	<b>0,06%</b>		<b>1,26%</b>

## Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2018

## FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.672,84	0,00	0,00	114.142,61	106.469,77	1,387,62%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	400.356,70	0,00	0,00	409.807,88	9.451,18	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	199.138,23	0,00	168.500,00	33.145,53	2.507,30	1,26%	1,75%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.132.430,59	0,00	0,00	1.134.489,72	2.059,13	0,18%	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	45.186,62	0,00	0,00	45.949,33	762,71	1,69%	1,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.298,07	0,00	0,00	6.427,48	129,41	2,05%	2,05%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	14.147,49	219.851,83	215.963,46	18.119,63	83,77	0,04%	0,30%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>121.463,27</b>	<b>6,00%</b>	

