

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)

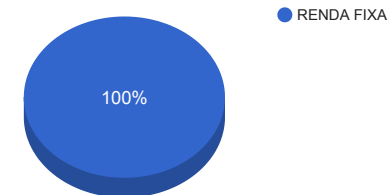
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	56.458,61	48,08%	1.477	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	19.031,92	16,21%	803	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	41.928,44	35,71%	750	0,23%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
Total			117.418,97				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2018)

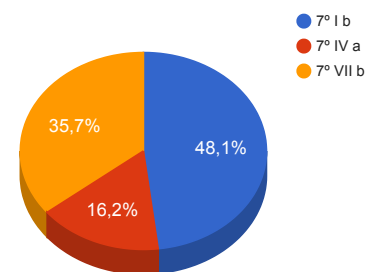
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	56.458,61	48,08%	20,00%	30,00%	70,00%	25.734,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	70.451,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	19.031,92	16,21%	5,00%	10,00%	30,00%	16.193,77
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	17.612,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	41.928,44	35,71%	2,00%	5,00%	5,00%	-36.057,49
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	11.741,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	11.741,90
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	11.741,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.870,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.870,95
Total Carteira		117.418,97					

RENDA FIXA	117.418,97	100,00%
RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	56.458,61	48,08%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	19.031,92	16,21%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	41.928,44	35,71%	2,00%	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%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	117.418,97	100,00%	54,00	225,00

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

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)

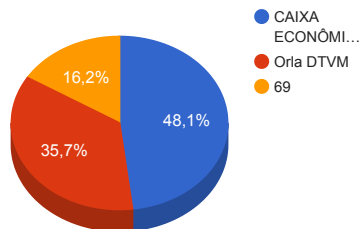
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.458,61	48,08%	0,00%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	41.928,44	35,71%	0,11%
69	19.031,92	16,21%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2018)

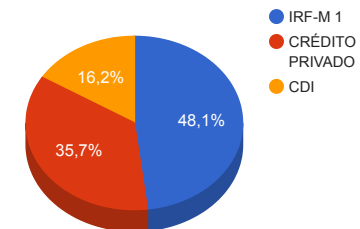
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,81%	2,02%	3,74%	6,81%	18,48%	0,20%	0,044%	0,55%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,47%	6,33%	1,49%	3,09%	6,33%	17,05%	0,20%	0,024%	0,04%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,37%	51,71%	20,56%	41,63%	51,71%	19,19%	2,00%	0,232%	23,17%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.458,61	48,08%
Orla DTVM	41.928,44	35,71%
69	19.031,92	16,21%



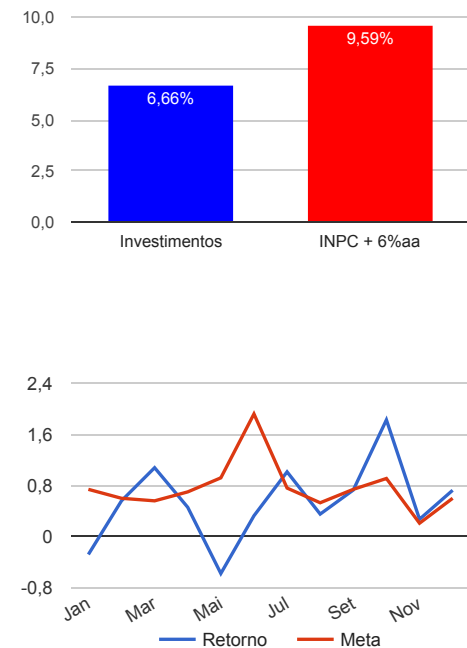
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	56.458,61	48,08%
CRÉDITO PRIVADO	41.928,44	35,71%
CDI	19.031,92	16,21%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	3.741.674,18	2.243.696,07	2.164.194,78	3.810.513,93	-10.661,54	-0,28%	0,74%	-37,65%	0,46%
Fevereiro	3.810.513,93	109.784,53	370.000,00	3.571.656,57	21.358,11	0,56%	0,60%	93,76%	0,53%
Março	3.571.656,57	889.801,29	860.591,70	3.639.700,40	38.834,24	1,08%	0,56%	193,59%	0,58%
Abril	3.639.700,40	811.596,40	1.473.796,13	2.994.208,49	16.707,82	0,46%	0,70%	65,79%	0,30%
Mai	2.994.208,49	101.866,65	526.050,10	2.552.763,39	-17.261,65	-0,58%	0,92%	-62,74%	0,82%
Junho	2.552.763,39	70.392,76	740.000,00	1.891.484,29	8.328,14	0,33%	1,92%	16,96%	1,67%
Julho	1.891.484,29	106.210,69	50.071,38	1.967.368,75	19.745,15	1,01%	0,76%	133,17%	0,53%
Agosto	1.967.368,75	9.881,45	213.785,17	1.770.402,84	6.937,81	0,35%	0,53%	66,13%	1,59%
Setembro	1.770.402,84	62.342,42	396.119,44	1.449.539,87	12.914,05	0,73%	0,74%	98,36%	0,58%
Outubro	1.449.539,87	149.979,70	624.608,68	1.001.393,51	26.482,62	1,83%	0,91%	200,32%	8,00%
Novembro	1.001.393,51	114.029,68	440.021,74	678.126,59	2.725,14	0,27%	0,21%	128,15%	0,65%
Dezembro	678.126,59	17.074,60	582.702,35	117.418,97	4.920,13	0,73%	0,60%	120,09%	0,11%
Acumulado no ano					131.030,02	6,66%	9,59%	69,48%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	149.270,45	0,00	150.875,52	0,00	1.605,07	1,08%	0,62%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	134.875,57	0,00	136.199,45	0,00	1.323,88	0,98%	0,60%	1,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.013,40	0,00	8.091,79	0,00	78,39	0,98%	0,42%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	106.707,72	0,00	107.708,96	0,00	1.001,24	0,94%	0,42%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	18.943,25	0,00	0,00	19.031,92	88,67	0,47%	0,02%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	138.710,04	8.447,65	91.300,35	56.458,61	601,27	0,41%	0,04%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	543,22	0,00	545,31	0,00	2,09	0,38%	0,04%	0,54%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	41.773,65	0,00	0,00	41.928,44	154,79	0,37%	0,23%	0,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.626,95	8.630,54	0,00	3,59	0,04%	0,00%	0,41%
Total Renda Fixa					4.858,99	0,81%	0,11%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	34.778,43	0,00	0,00	41.928,44	7.150,01	20,56%	20,56%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	251.709,71	0,00	257.708,96	0,00	5.999,25	3,02%	3,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	130.647,54	0,00	136.199,45	0,00	5.551,91	4,25%	4,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	400.558,47	22.477,33	371.300,35	56.458,61	4.723,16	1,60%	2,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	146.236,33	0,00	150.875,52	0,00	4.639,19	3,17%	3,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	135.059,17	0,00	138.091,79	0,00	3.032,62	3,19%	3,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	237.347,02	0,00	220.000,00	19.031,92	1.684,90	1,35%	1,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.593,48	258.606,65	263.260,96	0,00	60,83	0,08%	1,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	535,40	0,00	545,31	0,00	9,91	1,85%	2,00%
				Total Renda Fixa	32.851,78	3,00%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.118.887,97	1.149.708,96	0,00	30.820,99	7,52%	9,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.327.962,77	1.297.896,75	56.458,61	26.392,59	5,62%	6,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	378.803,00	385.000,00	789.675,52	0,00	25.872,52	7,18%	7,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.013.235,31	275.000,00	1.306.199,45	0,00	17.964,14	8,72%	9,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	339.266,33	0,00	355.835,82	0,00	16.569,49	4,88%	12,84%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	27.636,86	0,00	0,00	41.928,44	14.291,58	51,71%	51,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	129.625,11	138.583,58	0,00	8.958,47	7,92%	9,22%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	525.809,10	29.046,64	543.441,70	19.031,92	7.617,88	4,05%	6,33%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	228.112,66	231.174,74	0,00	3.062,08	1,34%	6,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	592.922,75	0,00	595.052,06	0,00	2.129,31	0,36%	6,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	200.520,17	202.337,01	0,00	1.816,84	5,77%	6,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	388.781,11	389.012,67	0,00	231,56	1,61%	5,29%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	219.917,89	220.046,25	0,00	128,36	0,92%	2,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	512.902,26	39.904,45	536.413,22	0,00	-16.393,49	-4,89%	12,76%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	351.098,57	27.005,82	357.719,05	0,00	-20.385,34	-3,45%	9,59%
				Total Renda Fixa	119.076,98	6,79%	

