

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2018)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	3.535.973,65	44,37%	693	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	416.967,95	5,23%	701	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	2.269.655,34	28,48%	1.473	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	692.877,52	8,69%	298	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	1.028.684,07	12,91%	321	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	24.983,92	0,31%	15.695	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
Total para cálculo dos limites da Resolução			7.969.142,45				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2018)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	6.222.596,94	78,08%	20,00%	0,00%	100,00%	1.746.545,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	1.746.545,51	21,92%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.746.545,51
Total Renda Fixa	100,00%	7.969.142,45	100,00%	20,00%	0,00%	100,00%	

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2018)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2018			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	

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	0,00	0,00	20,00	100,00

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2018)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	7.969.142,45	100,00	0,00

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 Outubro/2018 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	2,09%	7,91%	3,27%	3,89%	9,10%	23,42%	0,97%	2,33%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,92%	5,81%	1,97%	3,41%	7,06%	20,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,94%	5,67%	1,94%	3,35%	6,90%	19,82%	0,27%	0,55%
IMA-B 5 (Benchmark)	3,10%	8,23%	3,75%	4,10%	9,30%	24,04%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	3,10%	8,03%	3,70%	3,98%	9,07%	23,55%	1,61%	3,05%
CDI (Benchmark)	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,47%	4,65%	1,37%	2,76%	5,67%	16,44%	0,00%	0,02%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,10%	1,07%	0,30%	0,60%	1,38%	7,17%	0,00%	0,02%
IPCA (Benchmark)	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,69%	6,01%	2,50%	2,73%	7,14%	-	0,74%	1,72%

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

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

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	25.970.857,68	776.156,02	924.635,44	6.313.870,92	-19.508.507,34	-19.508.507,34	-75,12%	-75,12%	0,74%	0,74%	-10.134,97%	0,43%
Fevereiro	6.313.870,92	1.074.802,37	3.216.964,60	4.197.218,90	25.510,21	-19.482.997,13	0,40%	-75,02%	0,60%	1,34%	-5.583,98%	0,46%
Março	4.197.218,90	1.273.426,55	890.827,48	4.611.680,54	31.862,57	-19.451.134,56	0,70%	-74,84%	0,56%	1,91%	-3.922,56%	0,38%
Abril	4.611.680,54	1.201.088,29	508.263,39	5.323.478,97	18.973,53	-19.432.161,03	0,36%	-74,75%	0,70%	2,62%	-2.854,14%	0,34%
Maio	5.323.478,97	2.170.152,42	1.746.359,87	5.733.982,05	-13.289,47	-19.445.450,50	-0,23%	-74,81%	0,92%	3,56%	-2.100,25%	0,66%
Junho	5.733.982,05	373.673,88	1.335.675,24	4.791.061,66	19.080,97	-19.426.369,53	0,33%	-74,73%	1,92%	5,55%	-1.345,41%	1,31%
Julho	4.791.061,66	10.598.079,42	9.319.107,32	6.103.562,07	33.528,31	-19.392.841,22	0,22%	-74,67%	0,76%	6,36%	-1.174,50%	0,48%
Agosto	6.103.562,07	1.229.771,70	1.099.079,71	6.265.652,12	31.398,06	-19.361.443,16	0,50%	-74,54%	0,53%	6,92%	-1.076,47%	0,94%
Setembro	6.265.652,12	1.381.179,06	1.028.313,68	6.671.806,52	53.289,02	-19.308.154,14	0,81%	-74,34%	0,74%	7,72%	-963,21%	0,56%
Outubro	6.671.806,52	4.135.900,75	3.858.017,02	7.050.887,98	101.197,73	-19.206.956,41	1,46%	-73,97%	0,91%	8,70%	-850,15%	0,69%

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO

36M

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

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 Outubro/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 RESP LIMITAD...	404.441,28	0,00	0,00	416.967,95	12.526,67	3,10%	3,10%	1,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	3.512.829,69	0,00	50.000,00	3.535.973,65	73.143,96	2,08%	2,08%	0,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	1.011.552,22	0,00	0,00	1.028.684,07				