

# Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2018



## Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2018)

Produto / Fundo		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							



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

	Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratég	GAP		
		Resolução	Carteira \$	Carteira	Inf	Alvo	Sup	Superior
Artigo 7	<sup>70</sup> , Inciso I, Alínea b	100,00%	6.222.596,94	78,08%	20,00%	0,00%	100,00%	1.746.545,51
Artigo 7	<sup>70</sup> , Inciso IV, Alínea a	40,00%	1.746.545,51	21,92%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.746.545,51
Total Re	enda Fixa	100,00%	7.969.142,45	100,00%	20,00%	0,00%	100,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégi	GAP		
 Artigos - Renda Variaver/ Estruturado / infobiliario	Resolução		Carteria	Inf	Alvo	Sup	Superior
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 A	Alocação - 2018	Limite	Limite
	Carteira \$	Carteira %	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	20,00	100,00



Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2018

#### Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2018)

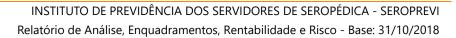
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão		
CAIXA DTVM S.A	7.969.142,45	100,00	0,00		

Artigo 20° - 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)



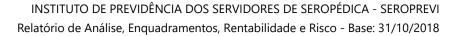


Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2018)



### 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	RF-M 1	
☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ ID	ΝV	
Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B 5	☐ IMA-B	
☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1	IRF-M 1+	
Ibovesna IRX SMII IDIV		



## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DE SEROPÉDICA - SEROPREVI

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/10/2018

## 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				