

# 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)

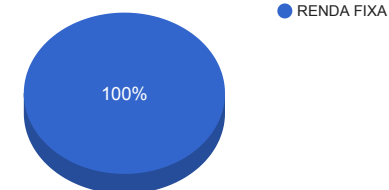
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.375.467,21	18,82%	395	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.160.986,22	17,62%	732	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.993.953,71	16,69%	724	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.279.623,19	18,28%	1.477	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.163.035,11	6,48%	425	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.872,73	0,02%	663	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.369.879,29	13,21%	827	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.592.017,59	8,88%	307	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>Total</b>			<b>17.937.835,05</b>				

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

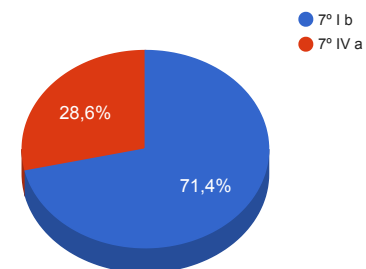
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.810.030,33	71,41%	15,00%	25,00%	100,00%	5.127.804,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	10.762.701,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	5.127.804,72	28,59%	5,00%	10,00%	40,00%	2.047.329,30
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	2.690.675,26
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	896.891,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	896.891,75
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	1.793.783,51
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	1.793.783,51
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	1.793.783,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	896.891,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	896.891,75
<b>Total Carteira</b>		<b>17.937.835,05</b>					

RENDA FIXA	17.937.835,05	100,00%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	12.810.030,33	71,41%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	5.127.804,72	28,59%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>17.937.835,05</b>	<b>100,00%</b>	<b>51,00</b>	<b>270,00</b>

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)

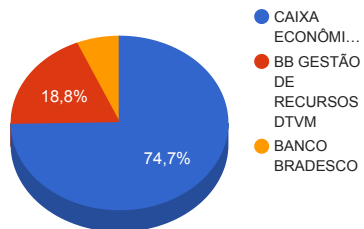
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.396.460,00	74,68%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.378.339,94	18,83%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.163.035,11	6,48%	0,00%

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

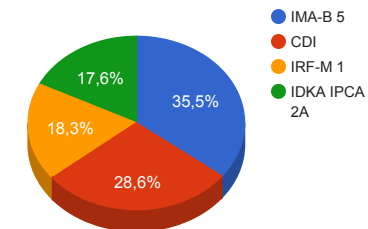
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,36%	9,87%	4,65%	6,86%	9,87%	23,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	9,67%	4,66%	6,81%	9,67%	23,25%	0,20%	0,598%	3,05%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,35%	9,65%	4,60%	6,77%	9,65%	23,27%	0,20%	0,585%	3,03%
IDKA IPCA 2 Anos	1,25%	9,75%	3,40%	6,58%	9,75%	24,69%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,16%	9,30%	3,40%	5,84%	9,30%	22,79%	0,20%	0,419%	2,35%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	6,23%	1,51%	3,06%	6,23%	16,79%	0,20%	0,006%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	5,55%	1,33%	2,72%	5,55%	15,10%	0,80%	0,000%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	5,29%	1,27%	2,60%	5,29%	14,62%	1,00%	0,004%	0,01%
Selic	0,49%	6,43%	1,54%	3,15%	6,43%	17,01%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	6,33%	1,51%	3,10%	6,33%	17,34%	0,20%	0,002%	0,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.396.460,00	74,68%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.378.339,94	18,83%
BANCO BRADESCO	1.163.035,11	6,48%



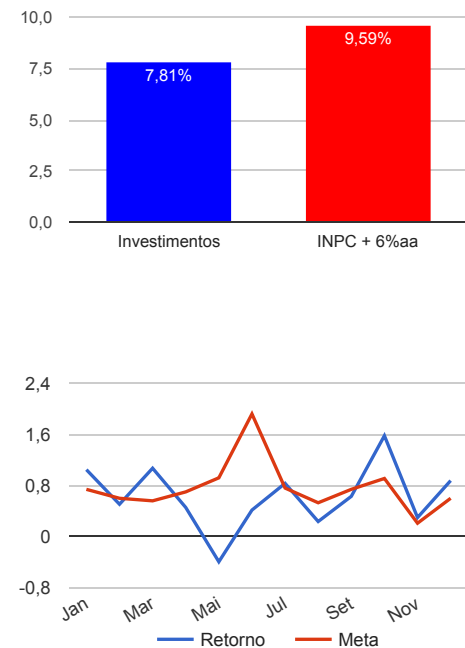
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	6.369.420,92	35,51%
CDI	5.127.804,72	28,59%
IRF-M 1	3.279.623,19	18,28%
IDKA IPCA 2A	3.160.986,22	17,62%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	13.308.159,65	1.900.000,00	0,00	15.367.553,69	159.394,04	1,05%	0,74%	141,41%	0,44%
Fevereiro	15.367.553,69	0,00	600.000,00	14.845.445,45	77.891,76	0,51%	0,60%	84,78%	0,56%
Março	14.845.445,45	3.600.000,00	0,00	18.642.902,97	197.457,52	1,07%	0,56%	192,16%	0,63%
Abril	18.642.902,97	2.000.000,00	100.000,00	20.636.691,16	93.788,19	0,46%	0,70%	65,43%	0,25%
Mai	20.636.691,16	1.700.900,00	2.000.000,00	20.256.434,54	-81.156,62	-0,39%	0,92%	-42,80%	0,58%
Junho	20.256.434,54	1.574.568,01	1.402.789,89	20.513.111,45	84.898,79	0,42%	1,92%	21,60%	1,18%
Julho	20.513.111,45	1.684.639,56	2.545.798,75	19.822.949,81	170.997,55	0,83%	0,76%	109,50%	0,34%
Agosto	19.822.949,81	6.240.568,04	6.539.399,16	19.570.990,03	46.871,34	0,24%	0,53%	44,34%	0,72%
Setembro	19.570.990,03	4.180.094,81	4.074.637,76	19.800.491,68	124.044,60	0,63%	0,74%	85,01%	0,54%
Outubro	19.800.491,68	1.649.009,33	1.748.166,25	20.013.967,72	312.632,96	1,58%	0,91%	173,12%	0,69%
Novembro	20.013.967,72	340.879,22	1.812.947,22	18.601.680,46	59.780,74	0,30%	0,21%	140,65%	0,44%
Dezembro	18.601.680,46	8.068.593,63	8.895.456,70	17.937.835,05	163.017,66	0,88%	0,60%	145,05%	0,29%
Acumulado no ano					1.409.618,53	7,81%	9,59%	81,46%	

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(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.330.570,23	0,00	0,00	3.375.467,21	44.896,98	1,35%	0,59%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.215.105,41	0,00	1.100.000,00	3.160.986,22	45.880,81	1,09%	0,42%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.865.676,12	1.100.000,00	0,00	2.993.953,71	28.277,59	0,95%	0,60%	1,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.552.370,01	0,00	2.300.000,00	3.279.623,19	27.253,18	0,49%	0,04%	0,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.157.416,27	0,00	0,00	1.163.035,11	5.618,84	0,49%	0,00%	0,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.861,10	0,00	0,00	2.872,73	11,63	0,41%	0,00%	0,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.261.717,98	1.000.000,00	900.000,00	2.369.879,29	8.161,31	0,25%	0,01%	0,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	215.963,34	5.968.593,63	4.595.456,70	1.592.017,59	2.917,32	0,05%	0,00%	0,43%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>163.017,66</b>	<b>0,88%</b>	<b>0,29%</b>	

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 (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.227.015,35	0,00	0,00	3.375.467,21	148.451,86	4,60%	4,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.123.565,39	0,00	1.100.000,00	3.160.986,22	137.420,83	3,33%	3,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.472.020,86	0,00	2.300.000,00	3.279.623,19	107.602,33	1,97%	2,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.807.191,56	1.100.000,00	0,00	2.993.953,71	86.762,15	4,22%	4,66%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.238.879,01	1.000.000,00	900.000,00	2.369.879,29	31.000,28	1,27%	1,51%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.145.681,56	0,00	0,00	1.163.035,11	17.353,55	1,51%	1,51%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.783.301,21	7.958.482,18	8.156.570,17	1.592.017,59	6.804,37	0,19%	1,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.836,74	0,00	0,00	2.872,73	35,99	1,27%	1,27%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>535.431,36</b>	<b>2,78%</b>	

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 (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.078.345,43	0,00	0,00	3.375.467,21	297.121,78	9,65%	9,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.952.206,76	1.100.000,00	4.350.000,00	2.993.953,71	291.746,95	9,40%	9,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.017.331,78	3.300.000,00	2.300.000,00	3.279.623,19	262.291,41	6,55%	6,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.110.862,51	2.900.000,00	1.100.000,00	3.160.986,22	250.123,71	8,53%	9,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	52.898,01	8.300.900,00	6.200.000,00	2.369.879,29	216.081,28	5,23%	6,23%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.093.786,66	0,00	0,00	1.163.035,11	69.248,45	6,33%	6,33%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	17.338.352,60	15.769.195,73	1.592.017,59	22.860,72	0,68%	5,55%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.728,50	0,00	0,00	2.872,73	144,23	5,29%	5,29%
Total Renda Fixa					1.409.618,53	7,81%	