

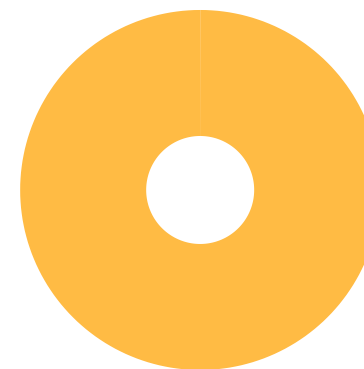
# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2018

**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	6.628.276,81	47,58%	1.471	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.413.032,95	24,50%	701	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.854.673,92	13,31%	822	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.043.606,47	7,49%	442	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	990.043,87	7,11%	110	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>13.929.634,02</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>22.988,50</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>13.952.622,52</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%	10.041.309,76	72,09%	50,00%	75,00%	100,00%	3.888.324,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	13.929.634,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	8.357.780,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	8.357.780,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	3.888.324,26	27,91%	0,00%	15,00%	40,00%	1.683.529,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	5.571.853,61
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.392.963,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.089.445,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	696.481,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	696.481,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	696.481,70
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>13.929.634,02</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>440,00%</b>	



RENDA FIXA 13.929.634,02

**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%	0,00%	20,00%	2.785.926,80
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.785.926,80
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	2.785.926,80
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.785.926,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	1.392.963,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	696.481,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	696.481,70
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>100,00%</b>	



7º I b 7º IV a

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.929.634,02	100,00	0,00

**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 '	10.041.309,76	72,09	50,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.888.324,26	27,91	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	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	20,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
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

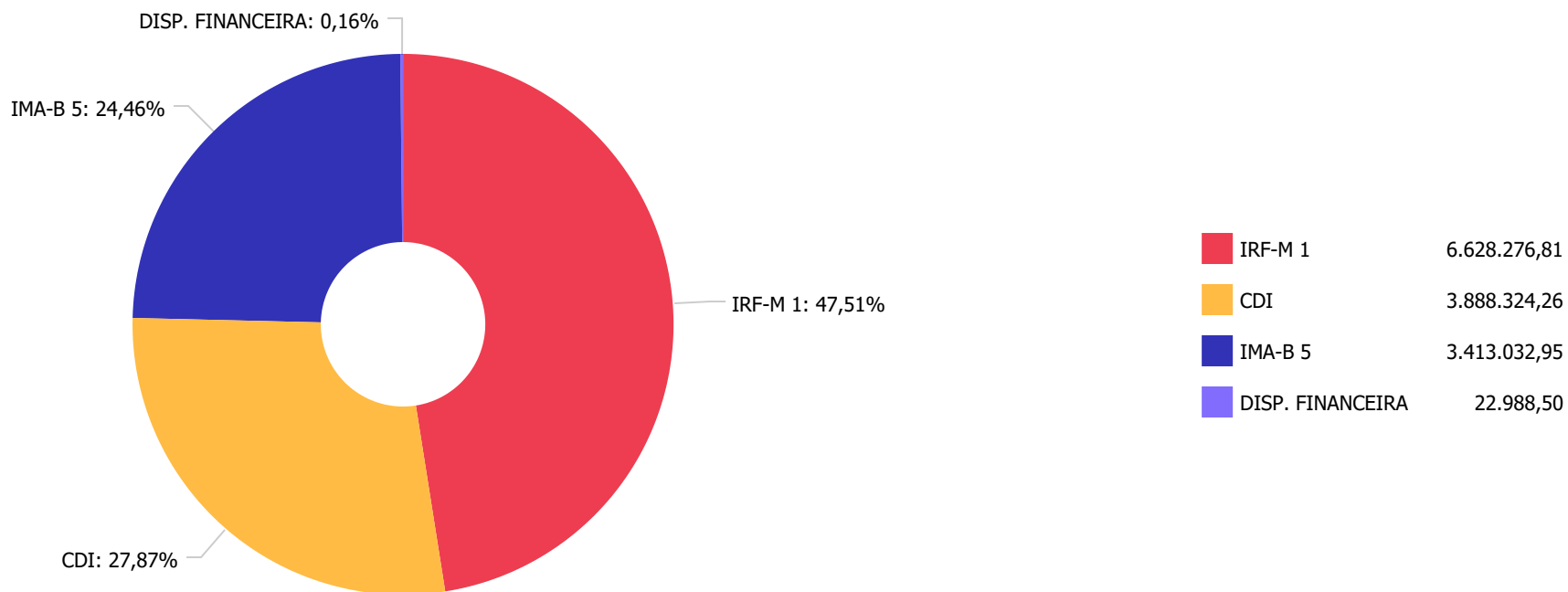
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2018 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>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>CDI (Benchmark)</b>	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	4,65%	1,53%	3,08%	6,48%	18,79%	0,00%	0,00%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	4,61%	1,54%	3,02%	6,44%	18,66%	0,00%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,47%	4,55%	1,55%	3,02%	6,37%	18,53%	0,00%	0,00%

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



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

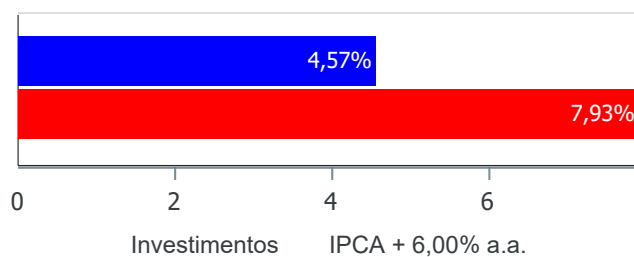




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018)

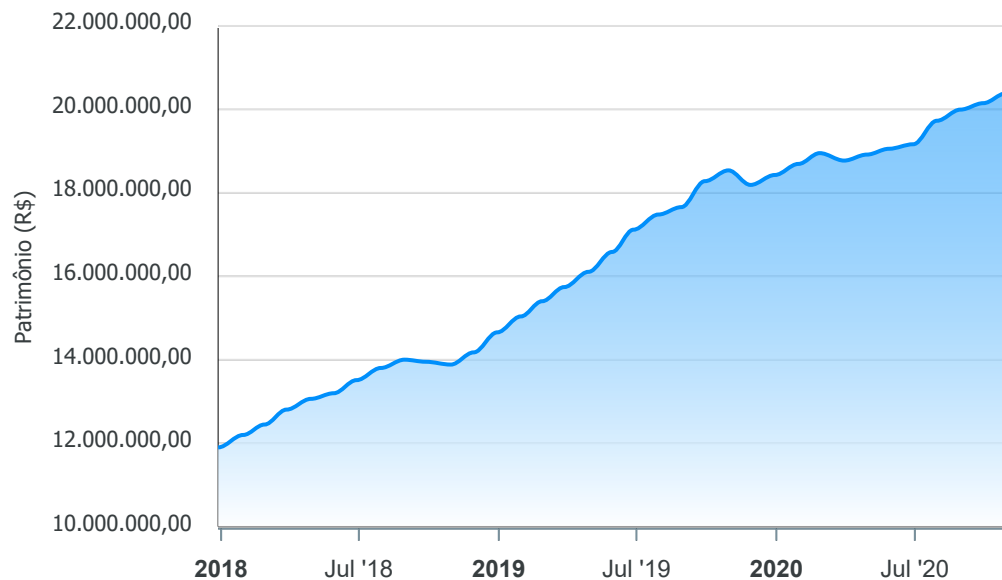
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	11.887.889,12	389.525,46	204.263,90	12.156.303,67	83.152,99	83.152,99	0,69%	0,69%	0,80%	0,80%	85,93%	0,16%
Fevereiro	12.156.303,67	423.500,00	227.401,00	12.414.826,06	62.423,39	145.576,38	0,51%	1,20%	0,74%	1,55%	77,47%	0,18%
Março	12.414.826,06	530.767,90	253.315,89	12.788.707,21	96.429,14	242.005,52	0,76%	1,97%	0,58%	2,13%	92,24%	0,28%
Abril	12.788.707,21	421.160,00	230.684,64	13.040.537,95	61.355,38	303.360,90	0,47%	2,45%	0,71%	2,85%	85,76%	0,15%
Maio	13.040.537,95	395.900,00	235.348,99	13.181.968,06	-19.120,90	284.240,00	-0,14%	2,30%	0,89%	3,77%	61,03%	0,47%
Junho	13.181.968,06	854.456,04	597.882,90	13.502.445,04	63.903,84	348.143,84	0,48%	2,79%	1,75%	5,59%	49,87%	1,13%
Julho	13.502.445,04	441.210,38	254.891,78	13.802.770,50	114.006,86	462.150,70	0,83%	3,64%	0,84%	6,48%	56,24%	0,33%
Agosto	13.802.770,50	404.577,48	253.266,68	13.992.115,28	38.033,98	500.184,68	0,27%	3,93%	0,44%	6,95%	56,49%	0,60%
Setembro	13.992.115,28	112.224,70	261.068,46	13.929.634,02	86.362,50	586.547,18	0,62%	4,57%	0,92%	7,93%	57,55%	0,39%

Investimentos x Meta Atuarial



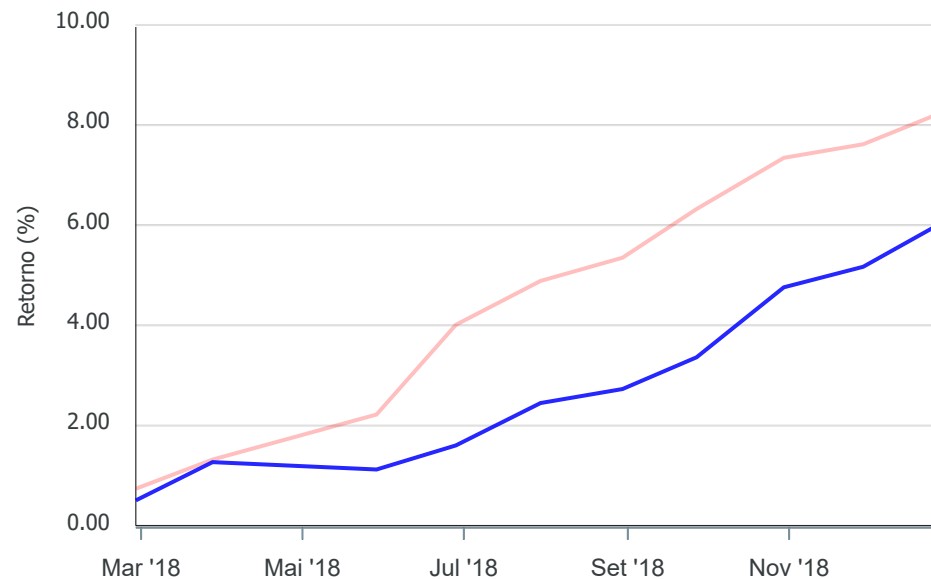
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos    Meta Atuarial     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 Setembro/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 FI RENDA FIX...	3.384.039,15	0,00	0,00	3.413.032,95	28.993,80	0,86%	0,86%	1,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.737.432,89	112.224,70	261.068,46	6.628.276,81	39.687,68	0,58%	0,59%	0,15%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	985.415,74	0,00	0,00	990.043,87	4.628,13	0,47%	0,47%	0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.038.761,36	0,00	0,00	1.043.606,47	4.845,11	0,47%	0,47%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.846.466,14	0,00	0,00	1.854.673,92	8.207,78	0,44%	0,44%	0,02%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>13.992.115,28</b>	<b>112.224,70</b>	<b>261.068,46</b>	<b>13.929.634,02</b>	<b>86.362,50</b>	<b>0,61%</b>		<b>0,39%</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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.729.389,50	553.435,08	769.226,92	6.628.276,81	114.679,15	1,57%	1,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.344.319,81	0,00	0,00	3.413.032,95	68.713,14	2,05%	2,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.425.945,94	404.577,48	0,00	1.854.673,92	24.150,50	1,32%	1,53%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.027.820,57	0,00	0,00	1.043.606,47	15.785,90	1,54%	1,54%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	974.969,22	0,00	0,00	990.043,87	15.074,65	1,55%	1,55%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>238.403,34</b>	<b>1,74%</b>	