

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2018)

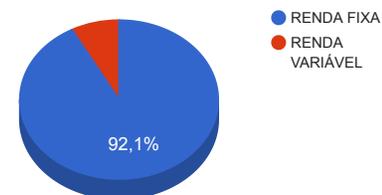
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
							3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	134.694,06	13,45%	701	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	106.566,61	10,64%	693	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	540,40	0,05%	1.268	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	137.881,54	13,77%	748	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	203.945,51	20,37%	1.473	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.995,51	3,00%	677	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	148.713,01	14,85%	321	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	118.463,63	11,83%	815	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	41.794,39	4,17%	750	0,23%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	78.798,85	7,87%	218	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
Total			1.001.393,51				

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

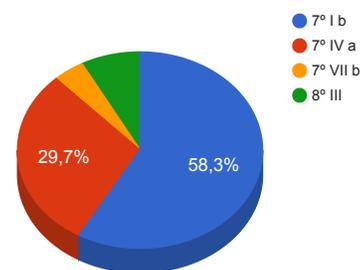
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	583.628,12	58,28%	20,00%	30,00%	70,00%	117.347,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	600.836,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	297.172,15	29,68%	5,00%	10,00%	30,00%	3.245,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	150.209,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	41.794,39	4,17%	2,00%	5,00%	5,00%	8.275,29
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	100.139,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	100.139,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	78.798,85	7,87%	7,00%	10,00%	10,00%	21.340,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	50.069,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	50.069,68
Total Carteira		1.001.393,51					

RENDA FIXA	922.594,66	92,13%
RENDA VARIÁVEL	78.798,85	7,87%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	583.628,12	58,28%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	297.172,15	29,68%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	41.794,39	4,17%	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	78.798,85	7,87%	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	1.001.393,51	100,00%	54,00	225,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	593.919,19	59,31%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	365.679,93	36,52%	0,00%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	41.794,39	4,17%	0,07%

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

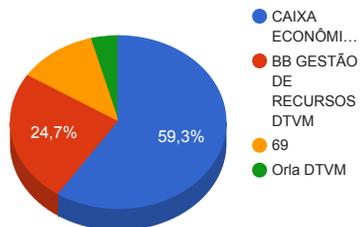
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	3,10%	8,23%	3,75%	4,10%	9,30%	24,04%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,10%	8,03%	3,70%	3,98%	9,07%	23,54%	0,20%	1,607%	3,05%
IDKA IPCA 2 Anos	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	7,79%	3,21%	3,90%	9,03%	23,32%	0,20%	0,977%	2,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,08%	7,91%	3,27%	3,89%	9,10%	23,42%	0,20%	0,971%	2,33%
IRF-M 1	0,92%	5,81%	1,97%	3,41%	7,06%	20,23%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	5,67%	1,94%	3,35%	6,90%	19,82%	0,20%	0,268%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,64%	1,93%	3,32%	6,85%	19,69%	0,10%	0,273%	0,55%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,32%	1,58%	3,15%	6,53%	18,49%	0,20%	0,009%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	4,43%	1,31%	2,63%	5,41%	16,02%	1,00%	0,003%	0,02%
IPCA	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,69%	6,01%	2,50%	2,73%	7,14%	-	0,002	0,740%	1,72%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	20,17%	51,23%	39,70%	43,60%	50,68%	103,56%	2,00%	176,337%	109,74%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2018)

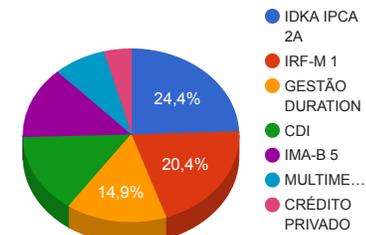
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,73%	5,83%	1,38%	3,16%	7,69%	20,32%	0,60%	0,221%	2,71%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	593.919,19	59,31%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	247.216,30	24,69%
69	118.463,63	11,83%
Orla DTVM	41.794,39	4,17%



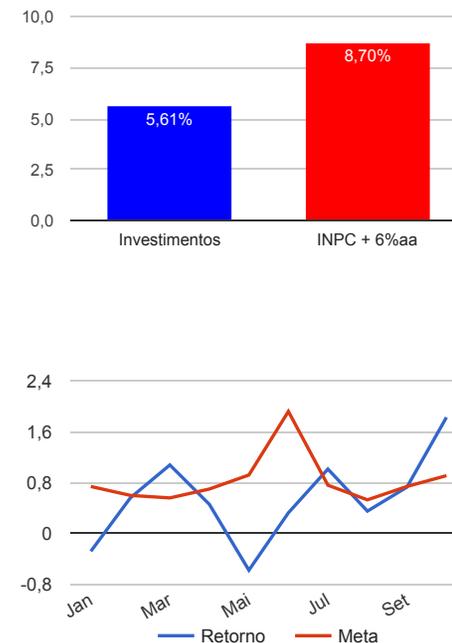
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	244.448,15	24,41%
IRF-M 1	204.485,91	20,42%
GESTÃO DURATION	148.713,01	14,85%
CDI	148.459,14	14,83%
IMA-B 5	134.694,06	13,45%
MULTIMERCADO	78.798,85	7,87%
CRÉDITO PRIVADO	41.794,39	4,17%



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%
Acumulado no ano					123.384,75	5,61%	8,70%	64,45%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	34.778,43	0,00	0,00	41.794,39	7.015,96	20,17%	176,34%	20,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	130.647,54	0,00	0,00	134.694,06	4.046,52	3,10%	1,61%	3,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	135.059,17	0,00	0,00	137.881,54	2.822,37	2,09%	0,98%	2,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	251.709,71	0,00	150.000,00	106.566,61	4.856,90	1,93%	0,97%	2,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	146.236,33	0,00	0,00	148.713,01	2.476,68	1,69%	0,74%	1,69%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	535,40	0,00	0,00	540,40	5,00	0,93%	0,27%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	400.558,47	0,00	200.000,00	203.945,51	3.387,04	0,85%	0,27%	0,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	237.347,02	0,00	120.000,00	118.463,63	1.116,61	0,47%	0,01%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.593,48	149.979,70	124.608,68	29.995,51	31,01	0,02%	0,00%	0,45%
				Total Renda Fixa	25.758,09	1,92%	8,66%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	108.074,32	0,00	30.000,00	78.798,85	724,53	0,67%	0,22%	0,73%
Total Renda Variável					724,53	0,67%	0,22%	