

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

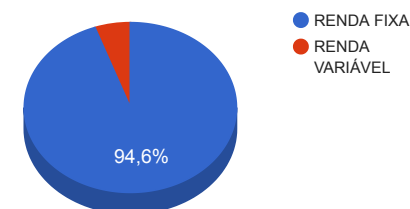
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.602.098,32	4,19%	169	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.482.098,03	6,49%	176	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.219.798,26	3,19%	202	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.838.421,65	7,42%	1.268	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	426.817,20	1,12%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.319.642,68	3,45%	701	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.710.795,72	7,09%	376	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.235.838,64	5,85%	505	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.541.509,42	6,64%	748	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.181.545,10	13,55%	1.473	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	552.097,62	1,44%	657	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.974.449,69	7,78%	164	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	3.133.871,83	8,19%	264	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.376.413,97	3,60%	8	1,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.261.131,07	3,30%	17	0,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.753.072,05	9,81%	815	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	392.830,75	1,03%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	167.759,49	0,44%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	949.847,89	2,48%	89	0,48%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.128.336,14	2,95%	146	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
TOTAL -			38.248.375,52				

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

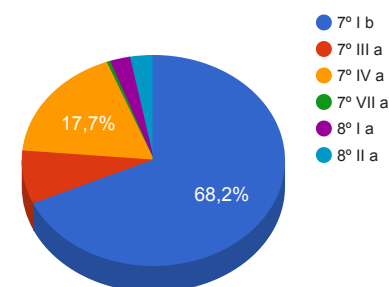
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	26.085.112,33	68,20%	15,00%	25,00%	70,00%	688.750,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	3.133.871,83	8,19%	5,00%	10,00%	60,00%	19.815.153,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.783.447,84	17,74%	5,00%	10,00%	30,00%	4.691.064,82
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	5.737.256,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	167.759,49	0,44%	2,00%	5,00%	5,00%	1.744.659,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.912.418,78
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	949.847,89	2,48%	2,00%	5,00%	10,00%	2.874.989,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.128.336,14	2,95%	2,00%	5,00%	10,00%	2.696.501,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	3.824.837,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.912.418,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.912.418,78
Total Carteira		38.248.375,52					

RENDA FIXA	36.170.191,49	94,57%
RENDA VARIÁVEL	2.078.184,03	5,43%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	26.085.112,33	68,20%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	3.133.871,83	8,19%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.783.447,84	17,74%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	167.759,49	0,44%	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 "	949.847,89	2,48%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.128.336,14	2,95%	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%
Total Renda Fixa	38.248.375,52	100,00%	51,00	230,00

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	17.200.901,72	44,97%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.113.833,13	44,74%	0,00%
ROMA ASSET	1.376.413,97	3,60%	0,35%
Elleven Gestora de Recursos	1.261.131,07	3,30%	0,23%
ITAÚ UNIBANCO	1.128.336,14	2,95%	0,00%
FINAXIS CORRETORA	167.759,49	0,44%	0,18%

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+	10,66%	11,58%	8,95%	5,99%	10,88%	27,81%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10,54%	11,30%	8,79%	5,85%	10,52%	26,71%	0,20%	5,987%	7,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10,50%	11,29%	8,77%	5,82%	10,54%	27,11%	0,20%	5,961%	7,89%
IMA-B	7,14%	10,23%	6,50%	5,19%	10,29%	26,38%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,07%	9,97%	6,40%	5,03%	10,00%	25,72%	0,20%	3,962%	5,48%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	7,05%	10,12%	6,43%	5,15%	10,20%	25,73%	0,20%	3,924%	5,38%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,71%	2,30%	0,28%	0,64%	3,31%	11,87%	0,20%	0,747%	4,35%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,38%	1,86%	0,50%	-1,18%	2,96%	16,83%	1,30%	0,835%	3,99%
IRF-M 1+	4,71%	8,87%	4,79%	3,72%	10,37%	29,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,07%	8,97%	4,80%	3,78%	10,39%	29,14%	0,20%	2,989%	4,69%
IRF-M	3,59%	7,99%	3,96%	3,58%	9,43%	27,10%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,58%	7,83%	3,91%	3,50%	9,22%	26,51%	0,20%	2,131%	3,38%
IMA Geral	3,47%	7,95%	3,90%	3,99%	8,90%	24,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,51%	7,55%	3,80%	3,77%	8,45%	23,45%	0,20%	1,856%	2,79%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3,07%	8,05%	3,70%	4,01%	9,09%	23,59%	0,20%	1,588%	3,03%

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

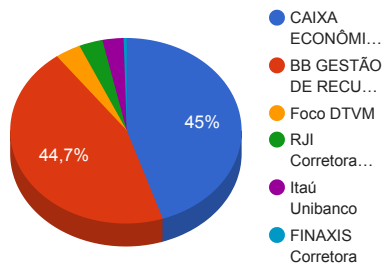
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,71%	8,25%	2,21%	2,84%	10,17%	28,52%	1,30%	3,031%	10,14%
IDKA IPCA 2 Anos	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	7,79%	3,21%	3,90%	9,03%	23,32%	0,20%	0,977%	2,33%
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%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,81%	7,37%	1,88%	5,00%	8,84%	16,33%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,31%	-6,49%	-0,82%	-3,14%	-5,52%	-12,15%	0,15%	0,173%	3,42%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	5,12%	1,56%	3,09%	6,26%	17,96%	0,20%	0,041%	0,07%
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%

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

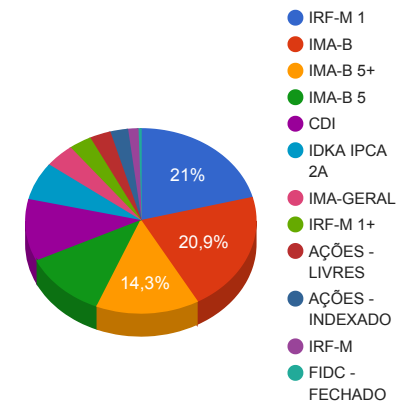
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	10,19%	14,43%	10,35%	1,52%	17,65%	34,66%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14,23%	18,14%	8,59%	2,95%	20,15%	43,49%	2,50%	15,935%	19,11%
IBX-50	9,71%	14,53%	10,29%	1,38%	17,73%	34,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	9,47%	12,95%	9,24%	0,08%	15,73%	32,63%	0,70%	15,916%	22,21%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.200.901,72	44,97%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.113.833,13	44,74%
Foco DTVM	1.376.413,97	3,60%
RJI Corretora de Valores	1.261.131,07	3,30%
Itaú Unibanco	1.128.336,14	2,95%
FINAXIS Corretora	167.759,49	0,44%



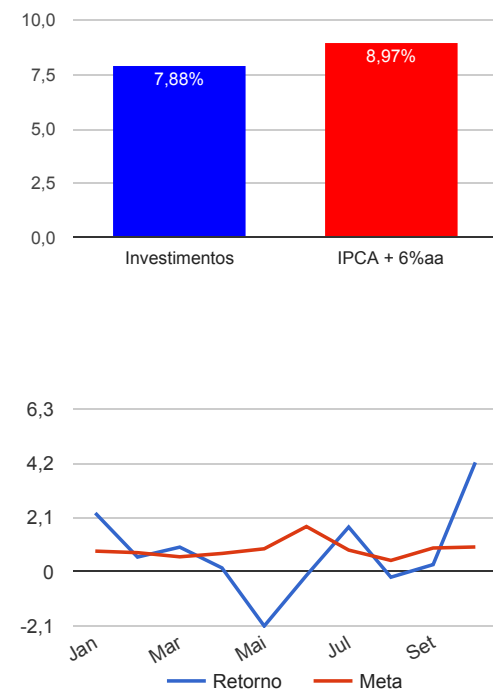
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.019.966,75	20,97%
IMA-B	8.007.255,51	20,93%
IMA-B 5+	5.456.547,72	14,27%
IMA-B 5	4.457.255,60	11,65%
CDI	4.145.902,80	10,84%
IDKA IPCA 2A	2.541.509,42	6,64%
IMA-GERAL	1.602.098,32	4,19%
IRF-M 1+	1.219.798,26	3,19%
AÇÕES - LIVRES	1.128.336,14	2,95%
AÇÕES - INDEXADO	949.847,89	2,48%
IRF-M	552.097,62	1,44%
FIDC - FECHADO	167.759,49	0,44%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	32.650.414,95	662.400,00	450.144,31	33.608.856,98	746.186,34	2,27%	0,80%	283,31%	1,70%
Fevereiro	33.608.856,98	617.800,00	464.435,26	33.954.570,31	192.348,59	0,57%	0,74%	77,15%	1,79%
Março	33.954.570,31	794.000,00	615.000,00	34.459.090,88	325.520,57	0,95%	0,58%	165,22%	1,26%
Abril	34.459.090,88	734.790,00	500.000,00	34.746.037,03	52.156,15	0,15%	0,71%	21,24%	1,18%
Mai	34.746.037,03	904.000,00	480.000,00	34.433.264,80	-736.772,23	-2,09%	0,89%	-235,72%	2,03%
Junho	34.433.264,80	1.100.000,00	121,41	35.483.401,38	-49.742,01	-0,14%	1,75%	-7,99%	2,82%
Julho	35.483.401,38	866.062,49	1.210.442,76	35.752.669,28	613.648,17	1,73%	0,84%	205,47%	1,34%
Agosto	35.752.669,28	1.710.000,00	1.820.000,00	35.568.400,44	-74.268,84	-0,21%	0,44%	-46,92%	2,44%
Setembro	35.568.400,44	1.145.000,00	500.000,00	36.314.161,46	100.761,02	0,28%	0,92%	30,16%	1,53%
Outubro	36.314.161,46	1.082.300,00	700.000,00	38.248.375,52	1.551.914,06	4,23%	0,96%	439,48%	2,91%
Acumulado no ano					2.721.751,82	7,88%	8,97%	87,78%	

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(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.245.488,38	0,00	0,00	2.482.098,03	236.609,65	10,54%	5,99%	10,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.928.554,70	0,00	250.000,00	2.974.449,69	295.894,99	10,10%	5,96%	10,50%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.088.202,23	0,00	0,00	2.235.838,64	147.636,41	7,07%	3,96%	7,07%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.927.572,44	0,00	0,00	3.133.871,83	206.299,39	7,05%	3,92%	7,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.160.984,91	0,00	0,00	1.219.798,26	58.813,35	5,07%	2,99%	5,07%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.547.725,85	0,00	0,00	1.602.098,32	54.372,47	3,51%	1,86%	3,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	503.796,27	30.000,00	0,00	552.097,62	18.301,35	3,43%	2,13%	3,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.279.997,61	0,00	0,00	1.319.642,68	39.645,07	3,10%	1,61%	3,10%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.629.967,51	0,00	0,00	2.710.795,72	80.828,21	3,07%	1,59%	3,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.489.485,94	0,00	0,00	2.541.509,42	52.023,48	2,09%	0,98%	2,09%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.353.260,16	0,00	0,00	1.376.413,97	23.153,81	1,71%	3,03%	1,71%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	419.659,80	0,00	0,00	426.817,20	7.157,40	1,71%	0,75%	1,71%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.243.913,75	0,00	0,00	1.261.131,07	17.217,32	1,38%	0,83%	1,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.812.132,91	0,00	0,00	2.838.421,65	26.288,74	0,93%	0,27%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.138.142,22	1.000.000,00	0,00	5.181.545,10	43.402,88	0,84%	0,27%	0,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.681.007,92	52.300,00	0,00	3.753.072,05	19.764,13	0,53%	0,01%	0,53%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	840.570,11	0,00	450.000,00	392.830,75	2.260,64	0,27%	0,04%	0,55%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	168.288,99	0,00	0,00	167.759,49	-529,50	-0,31%	0,17%	-0,31%
Total Renda Fixa					1.329.139,79	3,81%	2,16%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	987.752,12	0,00	0,00	1.128.336,14	140.584,02	14,23%	15,94%	14,23%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	867.657,64	0,00	0,00	949.847,89	82.190,25	9,47%	15,92%	9,47%
Total Renda Variável					222.774,27	12,01%	15,93%	