

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018



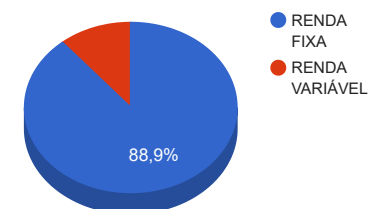
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.911.567,40	10,79%	674	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.975.497,96	7,32%	741	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.377.767,22	5,10%	678	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.353.607,34	5,02%	1.264	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.775.729,39	10,28%	1.457	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.055.737,48	3,91%	328	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.951.161,75	7,23%	315	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	637.928,32	2,36%	371	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.026.943,04	7,51%	715	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.054.712,17	11,32%	798	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	567.463,61	2,10%	156	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	62.803,41	0,23%	442	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	643.875,00	2,39%	51	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.978.160,28	7,33%	300	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.612.553,77	5,97%	809	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	997.932,59	3,70%	132	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.126.994,20	4,18%	210	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	879.415,10	3,26%	729	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	26.989.850,03				

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

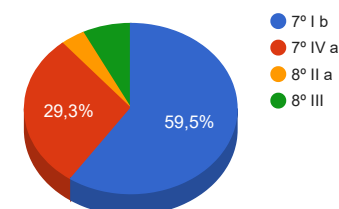
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	16.065.939,90	59,53%	15,00%	40,00%	100,00%	10.923.910,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	16.193.910,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.919.568,24	29,34%	5,00%	10,00%	40,00%	2.876.371,77
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	2.698.985,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.349.492,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.349.492,50
Total Renda Fixa	100,00%	23.985.508,14	88,87%	20,00	80,00	405,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	13,00%	3.508.680,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	997.932,59	3,70%	0,00%	10,00%	10,00%	1.701.052,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.006.409,30	7,43%	0,00%	5,00%	10,00%	692.575,70
Total Renda Variável	30,00%	3.004.341,89	11,13%	0,00	20,00	53,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	16.065.939,90	59,53%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
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%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.919.568,24	29,34%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
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%	10,00%
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%
Total Renda Fixa	23.985.508,14	88,87%	20,00	405,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	997.932,59	3,70%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.006.409,30	7,43%	0,00%	10,00%
Total Renda Variável	3.004.341,89	11,13%	0,00	53,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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	13.946.784,87	51,67%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.477.668,96	42,53%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	1.565.396,20	5,80%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,56%	4,19%	1,59%	3,14%	6,69%	19,60%	0,20%	0,008%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,56%	4,19%	1,59%	3,15%	6,68%	19,56%	0,20%	0,006%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	4,26%	1,58%	3,18%	6,86%	19,86%	0,20%	0,018%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	4,12%	1,56%	3,07%	6,64%	19,40%	0,20%	0,054%	0,08%
IRF-M 1	0,44%	4,21%	1,65%	3,04%	6,90%	20,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	4,08%	1,59%	2,94%	6,70%	20,53%	0,20%	0,244%	0,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	4,04%	1,58%	2,90%	6,64%	20,37%	0,10%	0,244%	0,52%
IDKA IPCA 2 Anos	0,10%	4,72%	1,86%	3,28%	8,04%	23,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	4,50%	1,41%	2,93%	7,39%	21,63%	0,20%	1,406%	2,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,08%	4,36%	1,45%	2,79%	7,27%	21,51%	0,20%	1,427%	2,22%
IRF-M	-0,93%	2,91%	0,57%	0,48%	5,93%	25,00%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,96%	2,79%	0,53%	0,37%	5,71%	24,46%	0,20%	2,220%	3,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,08%	2,80%	0,52%	0,24%	5,61%	24,40%	0,20%	2,263%	3,18%
IMA-B 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,26%	3,93%	1,63%	2,05%	6,45%	21,07%	0,20%	1,968%	2,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,27%	3,90%	1,61%	2,01%	6,42%	21,03%	0,20%	1,979%	2,83%

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

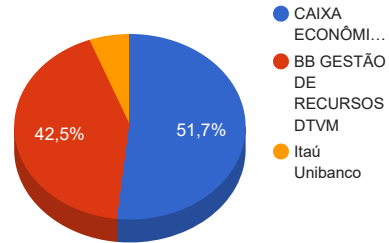
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral ex-C	-0,24%	3,47%	1,26%	1,03%	5,91%	22,22%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,39%	3,55%	1,17%	1,03%	5,73%	21,15%	0,30%	1,908%	2,63%
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,37%	4,87%	1,54%	2,56%	7,48%	-	0,40%	0,232%	1,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,14%	3,56%	1,54%	1,87%	5,95%	-	0,002	0,894%	1,68%

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

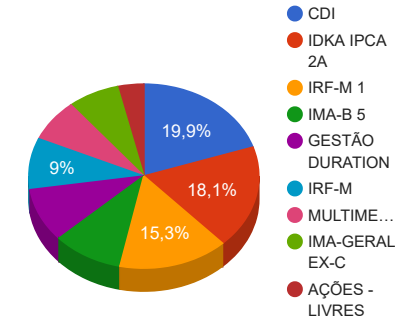
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,51%	3,86%	1,10%	2,92%	7,00%	20,78%	0,60%	2,298%	2,93%
Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,42%	-	0,44%	2,05%	-	-	1,60%	1,364%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,71%	4,76%	-0,86%	-4,57%	11,40%	41,22%	2,50%	8,612%	16,58%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.946.784,87	51,67%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.477.668,96	42,53%
Itaú Unibanco	1.565.396,20	5,80%

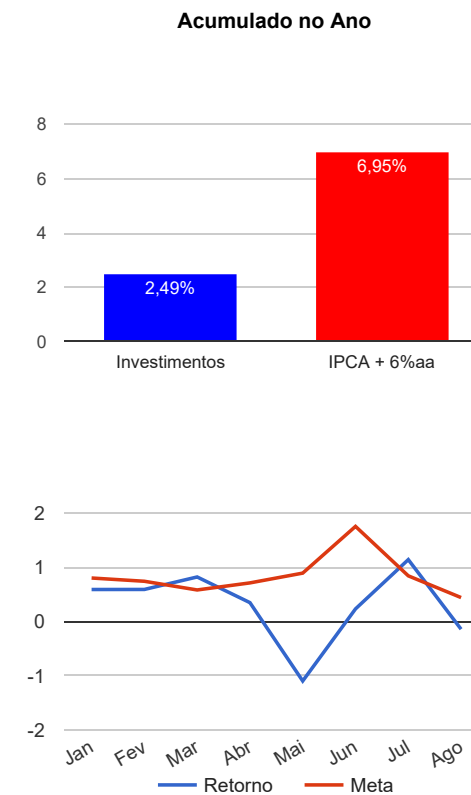


Sub-segmento	Valor	%
CDI	5.373.944,35	19,91%
IDKA IPCA 2A	4.887.065,36	18,11%
IRF-M 1	4.129.336,73	15,30%
IMA-B 5	2.664.871,36	9,87%
GESTÃO DURATION	2.545.623,89	9,43%
IRF-M	2.433.504,70	9,02%
MULTIMERCADO	2.006.409,30	7,43%
IMA-GERAL EX-C	1.951.161,75	7,23%
AÇÕES - LIVRES	997.932,59	3,70%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.114.796,24	3.180.488,84	1.411.492,78	18.994.909,23	111.116,93	0,59%	0,80%	73,42%	0,17%
Fevereiro	18.994.909,23	6.671.522,96	6.235.311,54	19.545.644,06	114.523,41	0,59%	0,74%	79,82%	0,52%
Março	19.545.644,06	7.876.624,97	4.554.186,22	23.055.353,84	187.271,03	0,82%	0,58%	141,88%	0,64%
Abril	23.055.353,84	2.074.935,98	2.054.518,18	23.155.806,78	80.035,14	0,35%	0,71%	49,00%	0,56%
Mai	23.155.806,78	1.092.350,56	76.701,24	23.906.803,62	-264.652,48	-1,09%	0,89%	-123,20%	1,16%
Junho	23.906.803,62	5.011.866,88	3.722.826,61	25.254.178,41	58.334,52	0,23%	1,75%	13,21%	1,92%
Julho	25.254.178,41	1.254.746,13	47.524,78	26.762.597,66	301.197,90	1,14%	0,84%	135,24%	0,85%
Agosto	26.762.597,66	322.327,46	56.716,23	26.989.850,03	-38.358,86	-0,14%	0,44%	-32,05%	1,36%
Acumulado no ano					549.467,59	2,49%	6,95%	35,79%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	640.310,84	0,00	0,00	643.875,00	3.564,16	0,56%	0,01%	0,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.998.940,91	39.663,11	500,00	3.054.712,17	16.608,15	0,55%	0,02%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.546.545,14	113.334,39	56.216,23	1.612.553,77	8.890,47	0,54%	0,01%	0,56%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	62.479,98	0,00	0,00	62.803,41	323,43	0,52%	0,05%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.764.492,91	0,00	0,00	2.775.729,39	11.236,48	0,41%	0,24%	0,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.348.277,03	0,00	0,00	1.353.607,34	5.330,31	0,40%	0,24%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	470.860,38	94.753,01	0,00	567.463,61	1.850,22	0,33%	0,23%	0,37%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.900.853,81	74.576,95	0,00	1.978.160,28	2.729,52	0,14%	0,89%	0,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.911.414,81	0,00	0,00	2.911.567,40	152,59	0,01%	1,41%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.977.016,58	0,00	0,00	1.975.497,96	-1.518,62	-0,08%	1,43%	-0,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	639.574,32	0,00	0,00	637.928,32	-1.646,00	-0,26%	1,97%	-0,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.032.435,89	0,00	0,00	2.026.943,04	-5.492,85	-0,27%	1,98%	-0,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.958.758,90	0,00	0,00	1.951.161,75	-7.597,15	-0,39%	1,91%	-0,39%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.391.062,66	0,00	0,00	1.377.767,22	-13.295,44	-0,96%	2,22%	-0,96%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.067.279,18	0,00	0,00	1.055.737,48	-11.541,70	-1,08%	2,26%	-1,08%
Total Renda Fixa					9.593,57	0,04%	1,01%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	883.145,75	0,00	0,00	879.415,10	-3.730,65	-0,42%	1,36%	-0,42%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.132.775,74	0,00	0,00	1.126.994,20	-5.781,54	-0,51%	2,30%	-0,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.036.372,83	0,00	0,00	997.932,59	-38.440,24	-3,71%	8,61%	-3,71%
Total Renda Variável					-47.952,43	-1,57%	4,12%	