

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018



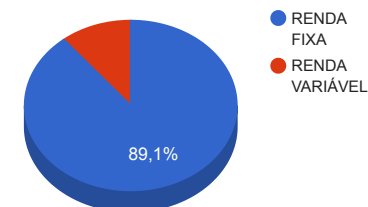
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.107.627,44	6,97%	701	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.006.515,82	9,94%	693	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.040.402,10	6,75%	748	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	663.224,23	2,19%	376	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.445.397,17	4,78%	657	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.374.324,47	4,54%	1.268	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.818.178,78	9,32%	1.473	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.109.422,77	3,67%	327	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.031.514,23	6,72%	311	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	63.436,61	0,21%	437	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	650.298,36	2,15%	55	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	3.202.664,35	10,59%	321	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.591.552,19	5,26%	821	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.129.846,89	10,35%	815	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	1.718.835,96	5,68%	185	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.233.369,80	4,08%	146	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	903.768,45	2,99%	729	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.148.368,52	3,80%	218	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	30.238.748,14				

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

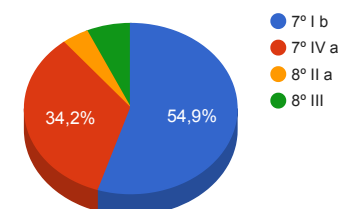
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	16.596.607,01	54,89%	15,00%	40,00%	100,00%	13.642.141,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	18.143.248,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	10.356.634,36	34,25%	5,00%	10,00%	40,00%	1.738.864,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	3.023.874,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.511.937,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.511.937,41
Total Renda Fixa	100,00%	26.953.241,37	89,13%	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%	3.931.037,26
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.233.369,80	4,08%	0,00%	10,00%	10,00%	1.790.505,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.052.136,97	6,79%	0,00%	5,00%	10,00%	971.737,84
Total Renda Variável	30,00%	3.285.506,77	10,87%	0,00	20,00	53,00	-

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	16.596.607,01	54,89%	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 "	10.356.634,36	34,25%	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	26.953.241,37	89,13%	20,00	405,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 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 "	1.233.369,80	4,08%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.052.136,97	6,79%	0,00%	10,00%
Total Renda Variável	3.285.506,77	10,87%	0,00	53,00

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	15.453.464,77	51,10%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.833.077,61	39,13%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	2.952.205,76	9,76%	0,00%

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
IRF-M	3,59%	7,99%	3,96%	3,58%	9,43%	27,10%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,86%	8,02%	3,95%	3,61%	9,40%	26,60%	0,20%	2,183%	3,50%
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 ex-C	3,43%	7,67%	3,81%	3,83%	8,63%	23,97%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,50%	7,82%	3,71%	3,93%	8,65%	23,07%	0,30%	1,886%	2,83%
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%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	5,17%	1,53%	3,06%	6,34%	18,07%	0,20%	0,033%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	5,21%	1,54%	3,10%	6,35%	18,18%	0,20%	0,007%	0,03%

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

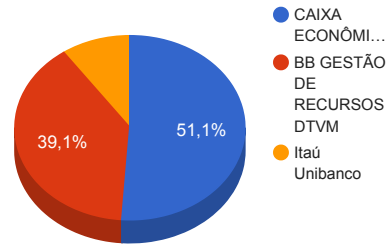
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,32%	1,58%	3,15%	6,53%	18,49%	0,20%	0,009%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,52%	5,23%	1,56%	3,12%	6,39%	18,24%	0,20%	0,006%	0,04%
IPCA	0,45%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,51%	5,84%	1,30%	2,13%	6,82%	-	0,40%	0,000%	1,19%

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

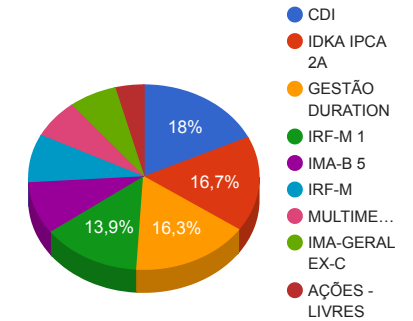
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	10,19%	14,43%	10,35%	1,52%	17,65%	34,66%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14,23%	18,14%	8,59%	2,95%	20,15%	43,49%	2,50%	15,935%	19,11%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,83%	-	2,34%	2,35%	-	-	1,60%	0,931%	-
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	15.453.464,77	51,10%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.833.077,61	39,13%
Itaú Unibanco	2.952.205,76	9,76%

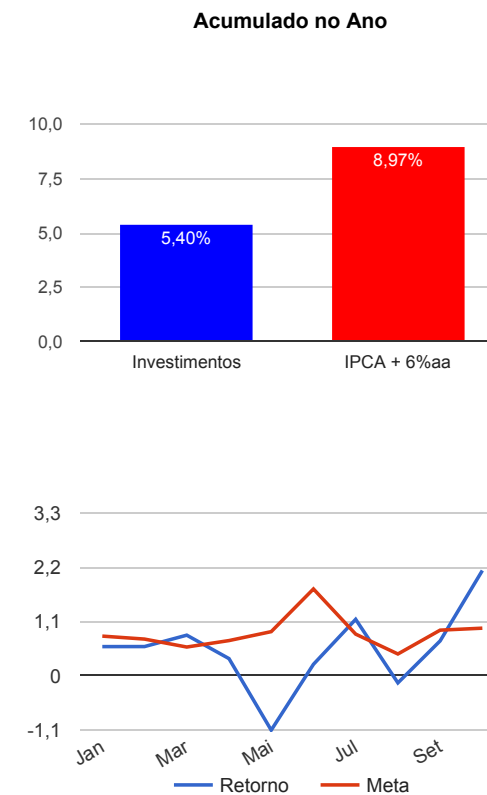


Sub-segmento	Valor	%
CDI	5.435.134,05	17,97%
IDKA IPCA 2A	5.046.917,92	16,69%
GESTÃO DURATION	4.921.500,31	16,28%
IRF-M 1	4.192.503,25	13,86%
IMA-B 5	2.770.851,67	9,16%
IRF-M	2.554.819,94	8,45%
MULTIMERCADO	2.052.136,97	6,79%
IMA-GERAL EX-C	2.031.514,23	6,72%
AÇÕES - LIVRES	1.233.369,80	4,08%



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%
Setembro	26.989.850,03	1.251.991,64	55.131,28	28.384.912,18	198.201,79	0,70%	0,92%	76,23%	0,92%
Outubro	28.384.912,18	1.278.159,02	52.659,88	30.238.748,14	628.336,82	2,12%	0,96%	220,52%	1,42%
Acumulado no ano					1.376.006,20	5,40%	8,97%	60,15%	



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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.068.224,30	0,00	0,00	1.109.422,77	41.198,47	3,86%	2,18%	3,86%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.395.414,24	0,00	0,00	1.445.397,17	49.982,93	3,58%	2,13%	3,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.962.875,42	0,00	0,00	2.031.514,23	68.638,81	3,50%	1,89%	3,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.044.309,50	0,00	0,00	2.107.627,44	63.317,94	3,10%	1,61%	3,10%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	643.448,77	0,00	0,00	663.224,23	19.775,46	3,07%	1,59%	3,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.998.636,05	0,00	0,00	2.040.402,10	41.766,05	2,09%	0,98%	2,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.945.117,75	0,00	0,00	3.006.515,82	61.398,07	2,08%	0,97%	2,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.994.946,17	1.166.795,20	0,00	3.202.664,35	40.922,98	1,29%	0,74%	1,69%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.792.070,71	0,00	0,00	2.818.178,78	26.108,07	0,94%	0,27%	0,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.361.595,82	0,00	0,00	1.374.324,47	12.728,65	0,93%	0,27%	0,93%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	63.096,34	0,00	0,00	63.436,61	340,27	0,54%	0,03%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.109.807,05	3.526,92	0,00	3.129.846,89	16.512,92	0,53%	0,01%	0,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.635.589,48	0,00	52.659,88	1.591.552,19	8.622,59	0,53%	0,01%	0,53%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	646.907,12	0,00	0,00	650.298,36	3.391,24	0,52%	0,01%	0,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.710.134,64	0,00	0,00	1.718.835,96	8.701,32	0,51%	0,00%	0,51%
Total Renda Fixa					463.405,77	1,75%	0,82%	

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	985.137,85	107.836,90	0,00	1.233.369,80	140.395,05	12,85%	15,94%	14,23%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	887.527,50	0,00	0,00	903.768,45	16.240,95	1,83%	0,93%	1,83%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.140.073,47	0,00	0,00	1.148.368,52	8.295,05	0,73%	0,22%	0,73%
Total Renda Variável					164.931,05	5,29%	6,32%	