

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

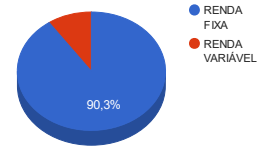
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.885,88	0,00%			Artigo 20
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.572.372,10	4,26%	1.264	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.135,59	0,02%	209	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	66.385.528,00	43,03%	1.457	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	111.746,25	0,07%	185	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.066.535,10	3,93%	674	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	157.657,44	0,10%	522	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	98.114,77	0,06%	678	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	29.611.151,59	19,19%	11	22,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.607.944,80	3,64%	110	1,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	24.694.349,53	16,01%	809	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	4.298.436,90	2,79%	37	2,69%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	Não se aplica	Não se aplica	4.846.310,23	3,14%		3,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1801	90 dias	5.784.963,41	3,75%	10	5,50%	Desenquadrado - RV
TOTAL -			154.268.131,59				

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

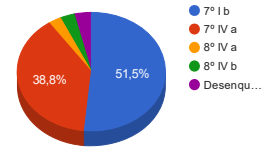
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	79.421.089,25	51,48%	0,00%	25,00%	70,00%	28.566.602,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	92.560.878,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	59.913.445,92	38,84%	0,00%	10,00%	40,00%	1.793.806,72
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	23.140.219,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.713.406,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.713.406,58
Total Renda Fixa	100,00%	139.334.535,17	90,32%	0,00	70,00	200,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	23.140.219,74
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,67%	10,00%	10,00%	15.426.813,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.298.436,90	2,79%	3,00%	5,00%	5,00%	3.414.969,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.846.310,23	3,14%	3,54%	5,00%	5,00%	2.867.096,35
Desenquadrado - RV	0,00%	5.784.963,41	3,75%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.784.963,41
Total Renda Variável	30,00%	14.929.710,54	9,68%	10,21	30,00	45,00	-

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 " b "	79.421.089,25	51,48%	0,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	59.913.445,92	38,84%	0,00%	40,00%
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%
Total Renda Fixa	139.334.535,17	90,32%	0,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	3,67%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.298.436,90	2,79%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.846.310,23	3,14%	3,54%	5,00%
Desenquadrado - RV	5.784.963,41	3,75%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	14.929.710,54	9,68%	10,21	45,00

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	102.783.493,02	66,63%	0,02%
ROMA ASSET	39.694.551,90	25,73%	8,40%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.939.890,56	4,50%	0,00%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	4.846.310,23	3,14%	10,31%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,56%	4,19%	1,59%	3,15%	6,68%	19,56%	0,20%	0,006%	0,05%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	4,06%	1,59%	3,05%	6,54%	19,27%	0,20%	0,045%	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%
IRF-M 1+	-1,47%	2,37%	0,16%	-0,49%	5,50%	26,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,65%	2,26%	0,11%	-0,80%	5,12%	25,78%	0,20%	3,056%	4,23%
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%
IMA-B 5+	-0,52%	1,88%	1,50%	-3,46%	2,62%	19,51%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,56%	1,73%	1,43%	-3,56%	2,34%	18,58%	0,20%	4,925%	6,83%
IMA-B	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,46%	2,88%	1,46%	-1,02%	4,31%	20,19%	0,20%	3,482%	4,81%
IMA-B 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-	-

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

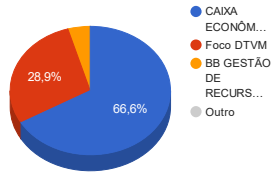
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,46%	6,39%	1,93%	5,54%	10,48%	27,44%	1,30%	0,579%	10,02%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

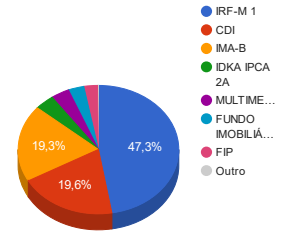
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	0,00%	-	0,00%	177,25%	-	-	1,50%	0,000%	30,50%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,90%	9,90%	-0,08%	4,87%	19,19%	6,23%	0,45%	1,183%	9,29%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,000%	0,10%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	102.783.493,02	66,63%
Foco DTVM	44.540.862,13	28,87%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.939.890,56	4,50%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.885,88	0,00%

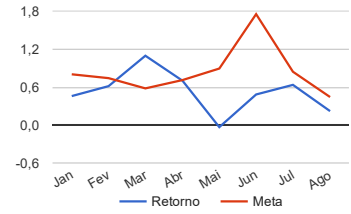
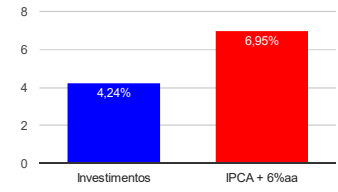


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	72.957.900,10	47,29%
CDI	30.302.294,33	19,64%
IMA-B	29.768.809,03	19,30%
IDKA IPCA 2A	6.066.535,10	3,93%
MULTIMERCADO	5.784.963,41	3,75%
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.846.310,23	3,14%
FIP	4.298.436,90	2,79%
IMA-B 5+	111.746,25	0,07%
IRF-M	98.114,77	0,06%
IRF-M 1+	29.135,59	0,02%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.885,88	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Acumulado no Ano



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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.557.724,35	0,00	0,00	24.694.349,53	136.625,18	0,56%	0,01%	0,56%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.578.149,49	0,00	0,00	5.607.944,80	29.795,31	0,53%	0,05%	0,53%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	29.476.575,71	0,00	0,00	29.611.151,59	134.575,88	0,46%	0,58%	0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	65.452.690,08	902.000,00	236.000,00	66.385.528,00	266.837,92	0,40%	0,24%	0,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.546.491,05	0,00	0,00	6.572.372,10	25.881,05	0,40%	0,24%	0,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.066.217,15	0,00	0,00	6.066.535,10	317,95	0,01%	1,41%	0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	158.389,31	0,00	0,00	157.657,44	-731,87	-0,46%	3,48%	-0,46%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	112.377,13	0,00	0,00	111.746,25	-630,88	-0,56%	4,92%	-0,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	99.061,58	0,00	0,00	98.114,77	-946,81	-0,96%	2,22%	-0,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.625,71	0,00	0,00	29.135,59	-490,12	-1,65%	3,06%	-1,65%
Total Renda Fixa					591.233,61	0,43%	0,33%	

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(%)
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.299.746,74	0,00	0,00	4.298.436,90	-1.309,84	-0,03%	0,00%	-0,03%
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.837.361,99	0,00	0,00	5.784.963,41	-52.398,58	-0,90%	1,18%	-0,90%
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	5.047.124,36	0,00	0,00	4.846.310,23	-200.814,13	-3,98%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					-254.522,55	-1,68%	0,46%	

