

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2018



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

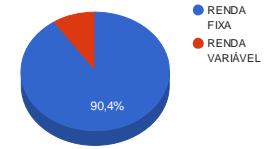
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.246,81	0,00%			Artigo 20
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	110.600,29	0,07%	181	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.136.440,52	3,95%	674	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	157.402,67	0,10%	507	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	99.371,47	0,06%	650	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.611.159,79	4,25%	1.267	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.549,84	0,02%	192	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	67.306.715,20	43,31%	1.471	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.634.283,18	3,63%	110	1,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	24.804.119,14	15,96%	822	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	29.622.605,43	19,06%	10	25,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	4.297.336,56	2,77%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	Não se aplica	Não se aplica	4.843.018,83	3,12%		3,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1801	90 dias	5.757.390,31	3,70%	11	5,50%	Desenquadrado - RV
TOTAL -			155.412.240,04				

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

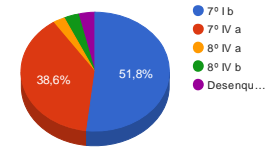
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80.451.239,78	51,77%	0,00%	25,00%	70,00%	28.337.328,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	93.247.344,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	60.061.007,75	38,65%	0,00%	10,00%	40,00%	2.103.888,27
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	23.311.836,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.770.612,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.770.612,00
Total Renda Fixa	100,00%	140.512.247,53	90,41%	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%	23.311.836,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,67%	10,00%	10,00%	15.541.224,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.297.336,56	2,77%	3,00%	5,00%	5,00%	3.473.275,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.843.018,83	3,12%	3,54%	5,00%	5,00%	2.927.593,17
Desenquadrado - RV	0,00%	5.757.390,31	3,70%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.757.390,31
Total Renda Variável	30,00%	14.897.745,70	9,59%	10,21	30,00	45,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	80.451.239,78	51,77%	0,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	60.061.007,75	38,65%	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	140.512.247,53	90,41%	0,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 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 "	4.297.336,56	2,77%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.843.018,83	3,12%	3,54%	5,00%
Desenquadrado - RV	5.757.390,31	3,70%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	14.897.745,70	9,59%	10,21	45,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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	103.911.107,88	66,86%	0,02%
ROMA ASSET	39.677.332,30	25,53%	13,56%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.978.534,22	4,49%	0,00%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	4.843.018,83	3,12%	10,39%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,57%	3,98%	1,88%	-0,49%	5,33%	25,58%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,72%	1,68%	-0,92%	4,85%	24,68%	0,20%	2,047%	4,32%
IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	5,71%	2,36%	2,56%	7,66%	21,41%	0,20%	0,875%	2,27%
IRF-M	1,30%	4,24%	1,83%	0,46%	5,74%	24,19%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	4,10%	1,80%	0,35%	5,53%	23,63%	0,20%	1,508%	3,14%
IMA-B 5	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,04%	6,43%	1,29%	2,51%	9,54%	24,00%	1,30%	0,926%	10,01%
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	4,66%	1,67%	2,86%	6,51%	19,70%	0,10%	0,163%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	1,69%	2,89%	6,57%	19,83%	0,20%	0,154%	0,52%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,47%	4,55%	1,55%	3,02%	6,37%	18,53%	0,20%	0,038%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	4,65%	1,53%	3,08%	6,48%	18,78%	0,20%	0,020%	0,04%
IMA-B 5+	-1,03%	0,83%	1,55%	-4,82%	-0,82%	16,33%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,03%	0,69%	1,48%	-4,85%	-1,01%	15,46%	0,20%	2,521%	6,89%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-

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

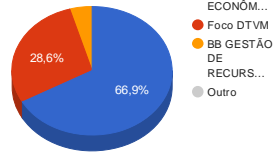
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,16%	2,71%	1,66%	-2,06%	2,32%	18,15%	0,20%	1,875%	4,86%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

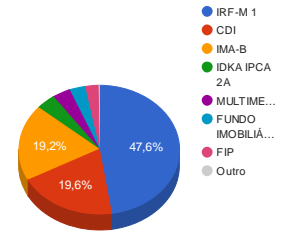
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,48%	9,38%	-0,55%	1,49%	17,36%	6,53%	0,45%	0,607%	9,24%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	-	1,50%	0,000%	30,56%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	103.911.107,88	66,86%
Foco DTVM	44.520.351,13	28,65%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.978.534,22	4,49%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.246,81	0,00%

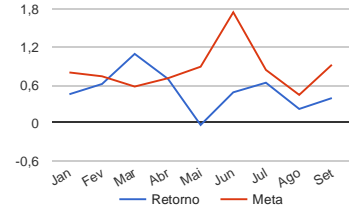
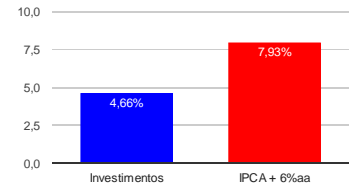


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	73.917.874,99	47,56%
CDI	30.438.402,32	19,59%
IMA-B	29.780.008,10	19,16%
IDKA IPCA 2A	6.136.440,52	3,95%
MULTIMERCADO	5.757.390,31	3,70%
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.843.018,83	3,12%
FIP	4.297.336,56	2,77%
IMA-B 5+	110.600,29	0,07%
IRF-M	99.371,47	0,06%
IRF-M 1+	29.549,84	0,02%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.246,81	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 setembro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.135,59	0,00	0,00	29.549,84	414,25	1,42%	2,05%	1,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	98.114,77	0,00	0,00	99.371,47	1.256,70	1,28%	1,51%	1,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.066.535,10	0,00	0,00	6.136.440,52	69.905,42	1,15%	0,88%	1,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.572.372,10	0,00	0,00	6.611.159,79	38.787,69	0,59%	0,16%	0,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	66.385.528,00	779.000,00	250.000,00	67.306.715,20	392.187,20	0,58%	0,15%	0,59%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.607.944,80	0,00	0,00	5.634.283,18	26.338,38	0,47%	0,04%	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.694.349,53	0,00	0,00	24.804.119,14	109.769,61	0,44%	0,02%	0,44%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	29.611.151,59	0,00	0,00	29.622.605,43	11.453,84	0,04%	0,93%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	157.657,44	0,00	0,00	157.402,67	-254,77	-0,16%	1,87%	-0,16%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	111.746,25	0,00	0,00	110.600,29	-1.145,96	-1,03%	2,52%	-1,03%
				Total Renda Fixa	648.712,36	0,46%	0,33%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.298.436,90	0,00	0,00	4.297.336,56	-1.100,34	-0.03%	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.846.310,23	0,00	0,00	4.843.018,83	-3.291,40	-0.07%	0,00%	0,00%
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.784.963,41	0,00	0,00	5.757.390,31	-27.573,10	-0.48%	0,61%	-0,48%
Total Renda Variável					-31.964,84	-0.21%	0,33%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	64.331.920,65	2.421.900,00	546.000,00	67.306.715,20	1.098.894,55	1,67%	1,69%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	29.244.190,56	0,00	0,00	29.622.605,43	378.414,87	1,29%	1,29%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.429.482,42	0,00	0,00	24.804.119,14	374.636,72	1,53%	1,53%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.994.919,09	0,00	0,00	6.136.440,52	141.521,43	2,36%	2,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.502.559,42	0,00	0,00	6.611.159,79	108.600,37	1,67%	1,67%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.548.494,20	0,00	0,00	5.634.283,18	85.788,98	1,55%	1,55%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	154.837,99	0,00	0,00	157.402,67	2.564,68	1,66%	1,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	97.613,85	0,00	0,00	99.371,47	1.757,62	1,80%	1,80%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	108.988,24	0,00	0,00	110.600,29	1.612,05	1,48%	1,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.060,86	0,00	0,00	29.549,84	488,98	1,68%	1,68%
				Total Renda Fixa	2.194.280,25	1,59%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.301.777,40	0,00	0,00	4.297.336,56	-4.440,84	-0,10%	-
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.823.015,95	0,00	0,00	5.757.390,31	-65.625,64	-1,13%	-0,55%
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	5.050.966,88	0,00	0,00	4.843.018,83	-207.948,05	-4,12%	0,00%
				Total Renda Variável	-278.014,53	-1,83%	

