

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018



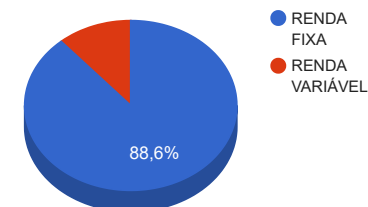
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			4.886.402,59	11,93%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	140.024,29	0,34%	100	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.213.941,45	12,73%	701	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.157.313,21	5,27%	28	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.115.784,72	12,49%	1.473	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.758.875,71	9,18%	693	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.814.377,78	6,87%	1.268	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRAPRESIRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	431.800,75	1,05%	304	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRAPRESIRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.981.666,21	7,28%	445	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.986.806,08	7,29%	391	1,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	503.134,42	1,23%	821	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	5.014.584,92	12,24%	321	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	285.370,41	0,70%	298	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	820.232,89	2,00%	1.611	1,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	3.845.907,81	9,39%	218	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>40.956.223,24</b>				

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

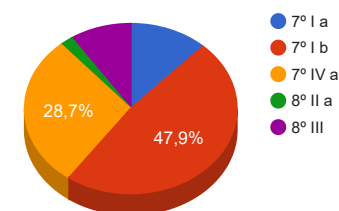
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	4.886.402,59	11,93%	0,00%	0,00%	15,00%	1.257.030,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	19.632.117,91	47,93%	15,00%	25,00%	80,00%	13.132.860,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	24.573.733,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.771.562,04	28,74%	5,00%	20,00%	30,00%	515.304,93
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	6.143.433,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.047.811,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.047.811,16
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>36.290.082,54</b>	<b>88,61%</b>	<b>20,00</b>	<b>70,00</b>	<b>215,00</b>	<b>-</b>

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%	820.232,89	2,00%	0,00%	12,00%	15,00%	5.323.200,60
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.845.907,81	9,39%	0,00%	8,00%	10,00%	249.714,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.047.811,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.047.811,16
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>4.666.140,70</b>	<b>11,39%</b>	<b>0,00</b>	<b>30,00</b>	<b>45,00</b>	<b>-</b>

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 "	4.886.402,59	11,93%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	19.632.117,91	47,93%	15,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.771.562,04	28,74%	5,00%	30,00%
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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>36.290.082,54</b>	<b>88,61%</b>	<b>20,00</b>	<b>215,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 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 "	820.232,89	2,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	3.845.907,81	9,39%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>4.666.140,70</b>	<b>11,39%</b>	<b>0,00</b>	<b>45,00</b>

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	22.878.497,71	55,86%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.800.309,88	16,60%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.413.466,96	8,33%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	2.977.546,10	7,27%	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
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%
IDKA IPCA 2 Anos	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,44%	1,59%	4,06%	7,04%	19,40%	0,20%	0,001%	0,55%
IPCA + 6,00% ao ano	0,96%	8,97%	2,34%	5,95%	10,78%	20,57%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,15%	6,46%	2,21%	3,59%	7,53%	21,56%	0,30%	0,384%	1,03%
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,91%	5,43%	1,88%	3,20%	6,61%	19,37%	0,40%	0,269%	0,55%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,59%	1,91%	3,26%	6,83%	19,70%	0,20%	0,265%	0,55%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	4,65%	1,37%	2,76%	5,67%	16,44%	0,80%	0,000%	0,02%
Selic	0,54%	5,39%	1,59%	3,20%	6,56%	18,38%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,54%	5,31%	1,56%	3,13%	6,46%	18,83%	0,20%	0,002%	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
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%

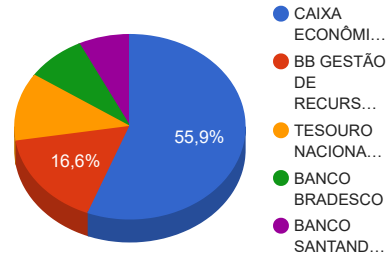
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS ON - PETR3	25,13%	80,01%	38,50%	23,59%	74,74%	63,31%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	24,81%	75,67%	37,53%	21,80%	69,66%	53,60%	3,00%	26,053%	47,92%
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%

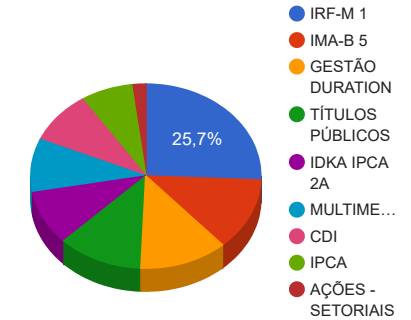


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (outubro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.878.497,71	55,86%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.800.309,88	16,60%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	4.886.402,59	11,93%
BANCO BRADESCO	3.413.466,96	8,33%
BANCO SANTANDER	2.977.546,10	7,27%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	10.519.276,46	25,68%
IMA-B 5	5.213.941,45	12,73%
GESTÃO DURATION	5.014.584,92	12,24%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.886.402,59	11,93%
IDKA IPCA 2A	3.898.900,00	9,52%
MULTIMERCADO	3.845.907,81	9,39%
CDI	3.770.171,04	9,21%
IPCA	2.986.806,08	7,29%
AÇÕES - SETORIAIS	820.232,89	2,00%

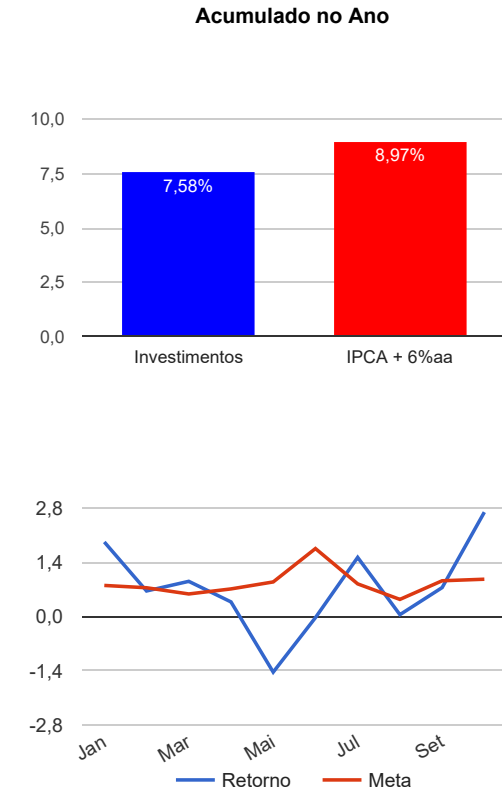


Carteira de Títulos Públicos - base (outubro / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	3.399,149839	743.672,41	1.699.574,92	955.902,51
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.399,149839	403.538,02	917.770,46	514.232,44
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	3.601,678114	695.984,05	2.269.057,21	1.573.073,16

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	38.757.739,16	2.972.609,68	2.153.420,29	40.336.639,48	759.710,93	1,92%	0,80%	239,51%	0,83%
Fevereiro	40.336.639,48	2.765.314,45	3.155.670,09	40.211.364,53	265.080,69	0,66%	0,74%	89,00%	1,02%
Março	40.211.364,53	2.172.334,15	2.476.966,16	40.270.755,06	364.022,54	0,91%	0,58%	156,84%	0,90%
Abril	40.270.755,06	2.114.957,65	2.424.066,43	40.112.776,57	151.130,29	0,38%	0,71%	53,02%	0,82%
Mai	40.112.776,57	11.367.215,45	11.779.413,97	39.125.452,50	-575.125,55	-1,43%	0,89%	-161,33%	2,02%
Junho	39.125.452,50	1.564.262,57	1.455.656,55	39.222.303,10	-11.755,42	-0,03%	1,75%	-1,71%	2,52%
Julho	39.222.303,10	2.588.935,17	2.825.909,46	39.582.456,48	597.127,67	1,52%	0,84%	180,88%	0,96%
Agosto	39.582.456,48	12.079.382,67	12.345.683,92	39.334.672,77	18.517,54	0,05%	0,44%	10,57%	1,25%
Setembro	39.334.672,77	5.952.801,22	5.486.654,60	40.097.036,54	296.217,15	0,74%	0,92%	80,69%	0,92%
Outubro	40.097.036,54	1.648.231,18	1.866.716,74	40.956.223,24	1.077.672,26	2,69%	0,96%	279,30%	1,16%
Acumulado no ano					2.942.598,10	7,58%	8,97%	84,51%	



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(%)
TÍTULOS PÚBLICOS	4.495.952,76	0,00	0,00	4.886.402,59	390.449,83	8,68%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.057.302,80	0,00	0,00	5.213.941,45	156.638,65	3,10%	1,61%	3,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.682.113,19	0,00	0,00	3.758.875,71	76.762,52	2,08%	0,97%	2,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.931.071,30	0,00	0,00	5.014.584,92	83.513,62	1,69%	0,74%	1,69%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.952.801,23	0,00	0,00	2.986.806,08	34.004,85	1,15%	0,38%	1,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.788.311,73	0,00	0,00	2.814.377,78	26.066,05	0,93%	0,27%	0,93%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	427.945,62	0,00	0,00	431.800,75	3.855,13	0,90%	0,26%	0,90%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.938.904,32	200.000,00	0,00	2.157.313,21	18.408,89	0,86%	0,27%	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.278.616,22	998.949,49	1.205.000,00	5.115.784,72	43.219,01	0,69%	0,27%	0,94%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.965.757,44	0,00	0,00	2.981.666,21	15.908,77	0,54%	0,00%	0,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	500.471,58	0,00	0,00	503.134,42	2.662,84	0,53%	0,01%	0,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	139.299,16	0,00	0,00	140.024,29	725,13	0,52%	0,00%	0,52%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	297.057,64	449.281,69	461.716,74	285.370,41	747,82	0,10%	0,00%	0,47%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>852.963,11</b>	<b>2,41%</b>	<b>0,63%</b>	

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(%)
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	823.304,02	0,00	200.000,00	820.232,89	196.928,87	23,92%	26,05%	24,81%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.818.127,53	0,00	0,00	3.845.907,81	27.780,28	0,73%	0,22%	0,73%
Total Renda Variável					224.709,15	4,84%	4,76%	