

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2018)

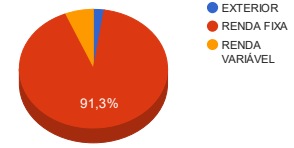
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	101.400,72	0,05%	756	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	41.974.328,88	21,28%	331	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	24.358.192,10	12,35%	1.472	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.490.656,00	1,26%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	25.251.997,95	12,80%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	14.242.381,40	7,22%	1.269	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	6.933.422,97	3,52%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.797.725,40	2,94%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	550.689,00	0,28%	807	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.748.292,77	2,41%	677	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.889,97	0,00%	300	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	27.915.688,10	14,15%	107	2,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	22.831.355,32	11,58%	329	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.218.077,00	1,12%	78	1,45%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23 DU	Não há	3.197.037,79	1,62%	54	2,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.401.458,23	0,71%	4.139	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.335.877,06	3,21%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.537.420,85	0,78%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.597.079,94	2,33%	2.112	10,73%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			196.484.971,45				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			738.254,18				Artigo 6º
Total			197.223.225,63				

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

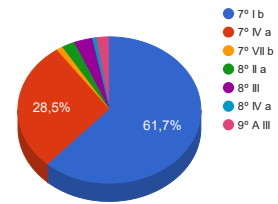
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	121.150.105,42	61,66%	50,00%	65,00%	100,00%	75.334.866,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	117.890.982,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	56.047.915,16	28,53%	0,00%	10,00%	30,00%	2.897.576,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.218.077,00	1,13%	0,00%	4,00%	5,00%	7.606.171,57
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.598.496,02	2,34%	0,00%	7,00%	15,00%	24.874.249,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.335.877,06	3,22%	0,00%	4,00%	5,00%	3.488.371,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.537.420,85	0,78%	0,00%	1,00%	5,00%	8.286.827,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	9.824.248,57
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	4.597.079,94	2,34%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.597.079,94
Total Carteira		196.484.971,45					

EXTERIOR	4.597.079,94	2,34%
RENDA FIXA	180.154.351,76	91,69%
RENDA VARIÁVEL	12.471.793,93	6,35%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: novembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	121.150.105,42	61,43%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
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%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	56.047.915,16	28,42%	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%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	2.218.077,00	1,12%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.598.496,02	2,33%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.335.877,06	3,21%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.537.420,85	0,78%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	4.597.079,94	2,33%	0,00%	0,00%
Total	196.484.971,45	99,63%	50,00	440,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	132.113.007,13	66,99%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	58.236.047,45	29,53%	0,01%
VINCI PARTNERS	3.197.037,79	1,62%	0,02%
FL Asset Management	1.537.420,85	0,78%	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.401.458,23	0,71%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	0,90%	11,22%	7,95%	9,60%	12,15%	29,10%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	8,53%	3,78%	5,38%	9,35%	23,44%	0,20%	0,777%	2,07%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,41%	3,06%	1,60%	3,49%	11,70%	0,20%	0,615%	4,37%
IMA Geral ex-C	0,78%	8,52%	4,87%	6,19%	9,48%	24,87%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	8,63%	4,91%	6,13%	9,61%	24,30%	0,30%	0,997%	2,79%
IRF-M 1	0,54%	6,38%	2,08%	3,77%	6,98%	19,62%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	6,23%	2,07%	3,69%	6,83%	19,23%	0,20%	0,073%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,19%	2,06%	3,67%	6,78%	19,10%	0,10%	0,073%	0,55%
CDI	0,49%	5,90%	1,51%	3,17%	6,47%	17,72%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,49%	6,15%	1,80%	3,43%	6,78%	18,32%	0,20%	0,003%	0,29%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	5,84%	1,52%	3,13%	6,46%	17,83%	0,20%	0,004%	0,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	5,10%	1,31%	2,74%	5,60%	15,81%	0,80%	0,000%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	4,86%	1,25%	2,62%	5,33%	15,36%	1,00%	0,003%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano	0,25%	9,25%	2,15%	5,28%	10,24%	20,10%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	9,19%	5,49%	7,57%	10,26%	26,17%	0,15%	1,583%	5,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,12%	6,48%	3,36%	4,78%	6,92%	17,93%	0,20%	0,692%	2,20%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	8,40%	3,51%	5,44%	9,65%	24,73%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	7,90%	3,40%	4,89%	8,83%	22,80%	0,20%	0,695%	2,35%
IPCA	-0,21%	3,59%	0,72%	2,23%	4,05%	6,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,37%	6,40%	2,74%	4,33%	7,25%	19,88%	0,002	0,980%	1,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	9,22%	5,51%	7,13%	10,24%	26,36%	0,20%	1,451%	4,72%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

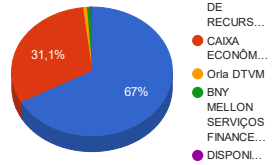
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	2,38%	17,15%	16,73%	16,61%	24,36%	44,58%	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	6,17%	10,24%	16,14%	12,64%	18,92%	48,28%	1,72%	8,672%	18,69%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2,44%	19,20%	15,91%	11,23%	27,46%	52,35%	2,00%	9,703%	21,97%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,80%	-	4,63%	-	-	-	1,60%	0,830%	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (novembro / 2018)

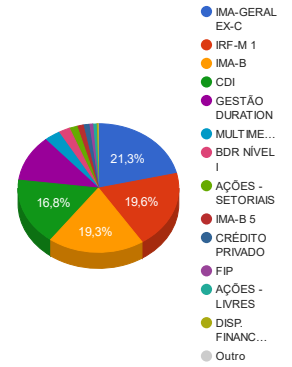
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	2,66%	16,93%	17,02%	16,97%	24,35%	45,33%	-	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,97%	21,62%	-11,25%	5,84%	25,81%	37,58%	1,60%	9,369%	17,13%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	132.113.007,13	66,99%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	61.433.085,24	31,15%
Orla DTVM	1.537.420,85	0,78%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.401.458,23	0,71%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	738.254,18	0,37%

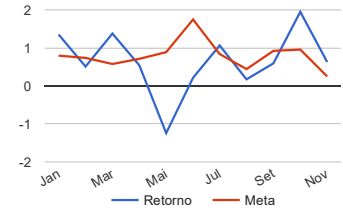
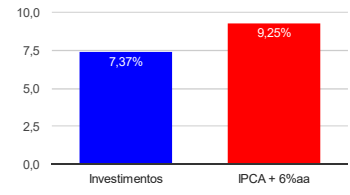


Sub-segmento	Valor	%
IMA-GERAL EX-C	41.974.328,88	21,28%
IRF-M 1	38.600.573,50	19,57%
IMA-B	37.983.146,32	19,26%
CDI	33.216.559,84	16,84%
GESTÃO DURATION	22.831.355,32	11,58%
MULTIMERCADO	6.335.877,06	3,21%
BDR NÍVEL I	4.597.079,94	2,33%
AÇÕES - SETORIAIS	3.197.037,79	1,62%
IMA-B 5	2.490.656,00	1,26%
CRÉDITO PRIVADO	2.218.077,00	1,12%
FIP	1.537.420,85	0,78%
AÇÕES - LIVRES	1.401.458,23	0,71%
DISP. FINANCEIRA	738.254,18	0,37%
IDKA IPCA 2A	101.400,72	0,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.308.150,40	1.360.000,00	0,00	41.974.328,88	306.178,48	0,73%	1,00%	0,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.230.173,51	0,00	0,00	24.358.192,10	128.018,59	0,53%	0,07%	0,53%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	27.778.807,96	0,00	0,00	27.915.688,10	136.880,14	0,49%	0,00%	0,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	548.011,92	0,00	0,00	550.689,00	2.677,08	0,49%	0,00%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.857.861,94	0,00	2.696.085,57	14.242.381,40	80.605,03	0,48%	0,07%	0,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	22.746.094,53	0,00	0,00	22.831.355,32	85.260,79	0,37%	0,98%	0,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.193.026,72	0,00	0,00	25.251.997,95	58.971,23	0,23%	1,45%	0,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.788.048,55	0,00	0,00	5.797.725,40	9.676,85	0,17%	0,78%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.882.558,09	5.968.622,64	4.116.263,92	4.748.292,77	13.375,96	0,15%	0,00%	0,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.112.374,13	0,00	188.121,69	6.933.422,97	9.170,53	0,13%	1,58%	0,13%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.215.420,50	0,00	0,00	2.218.077,00	2.656,50	0,12%	0,69%	0,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	101.290,76	0,00	0,00	101.400,72	109,96	0,11%	0,69%	0,11%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.488.060,00	0,00	0,00	2.490.656,00	2.596,00	0,10%	0,61%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.698,42	864.000,00	864.000,00	1.889,97	191,55	0,02%	0,00%	0,43%
				Total Renda Fixa	836.368,69	0,47%	0,68%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.197.422,43	864.000,00	0,00	3.197.037,79	135.615,36	4,43%	8,67%	6,17%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.368.112,78	0,00	0,00	1.401.458,23	33.345,45	2,44%	9,70%	2,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.285.405,97	0,00	0,00	6.335.877,06	50.471,09	0,80%	0,83%	0,80%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.537.577,76	0,00	0,00	1.537.420,85	-156,91	-0,01%	-	-
Total Renda Variável					219.274,99	1,79%	4,26%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.421.501,35	0,00	0,00	4.597.079,94	175.578,59	3,97%	9,37%	3,97%
				Total Exterior	175.578,59	3,97%	9,37%	

