

# 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)

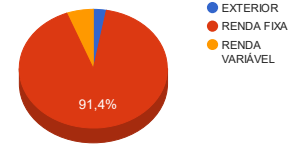
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	98.068,75	0,05%	741	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	38.713.842,10	20,88%	315	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.116.610,71	7,62%	1.457	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.416.740,00	1,30%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	23.933.710,19	12,91%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	11.185.028,14	6,03%	1.264	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	6.750.668,13	3,64%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.586.690,62	3,01%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	542.452,04	0,29%	798	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.371.631,34	3,98%	665	0,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.332,48	0,00%	291	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	33.344.925,25	17,99%	114	2,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	22.221.439,03	11,99%	300	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.145.933,00	1,16%	79	1,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	5.179.997,96	2,79%	1.864	8,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23 DU	Não há	2.008.804,98	1,08%	56	2,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.209.052,77	0,65%	4.371	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.055.339,19	3,27%	956	1,38%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.537.891,29	0,83%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>184.421.157,97</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			948.181,56				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>185.369.339,53</b>				

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

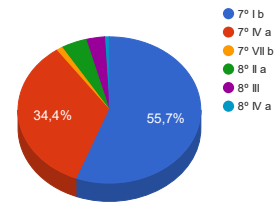
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	102.801.358,64	55,74%	50,00%	65,00%	100,00%	81.619.799,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	110.652.694,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	63.482.780,14	34,42%	0,00%	10,00%	30,00%	-8.156.432,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.145.933,00	1,16%	0,00%	4,00%	5,00%	7.075.124,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	8.397.855,71	4,55%	0,00%	7,00%	15,00%	19.265.317,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.055.339,19	3,28%	0,00%	4,00%	5,00%	3.165.718,71
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.537.891,29	0,83%	0,00%	1,00%	5,00%	7.683.166,61
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	9.221.057,90
<b>Total Carteira</b>		<b>184.421.157,97</b>					

EXTERIOR	5.179.997,96	2,81%
RENDA FIXA	169.378.253,34	91,84%
RENDA VARIÁVEL	10.811.088,23	5,86%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	102.801.358,64	55,46%	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 "	63.482.780,14	34,25%	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 "	2.145.933,00	1,16%	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 "	8.397.855,71	4,53%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.055.339,19	3,27%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.537.891,29	0,83%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>184.421.157,97</b>	<b>99,49%</b>	<b>50,00</b>	<b>440,00</b>

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	132.707.014,52	71,59%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	46.958.394,41	25,33%	0,01%
VINCI PARTNERS	2.008.804,98	1,08%	0,01%
FL Asset Management	1.537.891,29	0,83%	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.209.052,77	0,65%	0,00%

**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%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,56%	4,27%	1,59%	3,19%	6,86%	20,05%	0,20%	0,019%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	4,26%	1,58%	3,18%	6,86%	19,86%	0,20%	0,018%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,49%	3,74%	1,41%	2,80%	5,96%	17,77%	0,80%	0,000%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	3,57%	1,35%	2,67%	5,70%	17,40%	1,00%	0,004%	0,04%
IPCA + 6,00% ao ano	0,44%	6,95%	3,06%	5,32%	10,39%	19,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00%	3,02%	1,37%	1,58%	5,15%	16,21%	0,20%	1,394%	2,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	3,51%	1,97%	0,73%	5,34%	21,45%	0,15%	3,369%	4,65%
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%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,08%	4,36%	1,45%	2,79%	7,27%	21,51%	0,20%	1,427%	2,22%
IMA-B	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	4,58%	1,55%	2,90%	7,05%	21,51%	0,20%	1,397%	1,84%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,59%	-0,63%	-1,42%	0,31%	2,11%	10,58%	0,20%	4,500%	4,36%
IMA Geral ex-C	-0,24%	3,47%	1,26%	1,03%	5,91%	22,22%	-	-	-

## 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
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,39%	3,55%	1,17%	1,03%	5,73%	21,15%	0,30%	1,908%	2,63%
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,14%	3,56%	1,54%	1,87%	5,95%	-	0,002	0,894%	1,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,66%	3,52%	1,54%	0,90%	5,54%	21,73%	0,20%	3,232%	4,39%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

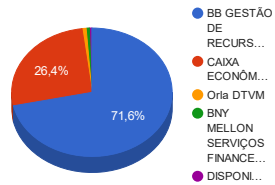
## Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,77%	-5,08%	-3,02%	-11,47%	2,30%	11,38%	1,72%	9,272%	18,19%
XP INVESTOR FI AÇÕES	-7,70%	2,84%	-4,04%	-7,56%	7,92%	33,15%	2,00%	13,088%	18,99%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	-	-	-	-	-	-	1,60%	-	-
IBX	-3,13%	-0,08%	-0,04%	-10,15%	7,35%	31,46%	-	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	14,56%	37,04%	19,26%	34,53%	53,64%	71,01%	1,60%	5,976%	15,01%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

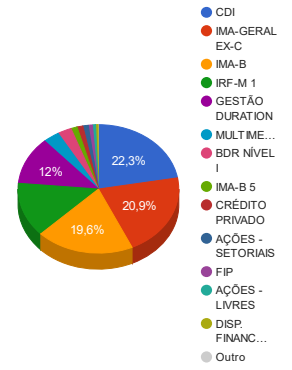


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (agosto / 2018)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	132.707.014,52	71,59%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.967.199,39	26,42%
Orla DTVM	1.537.891,29	0,83%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.209.052,77	0,65%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	948.181,56	0,51%

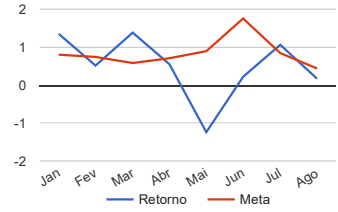
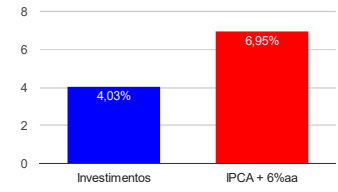


Sub-segmento	Valor	%
CDI	41.261.341,11	22,26%
IMA-GERAL EX-C	38.713.842,10	20,88%
IMA-B	36.271.068,94	19,57%
IRF-M 1	25.301.638,85	13,65%
GESTÃO DURATION	22.221.439,03	11,99%
MULTIMERCADO	6.055.339,19	3,27%
BDR NÍVEL I	5.179.997,96	2,79%
IMA-B 5	2.416.740,00	1,30%
CRÉDITO PRIVADO	2.145.933,00	1,16%
AÇÕES - SETORIAIS	2.008.804,98	1,08%
FIP	1.537.891,29	0,83%
AÇÕES - LIVRES	1.209.052,77	0,65%
DISP. FINANCEIRA	948.181,56	0,51%
IDKA IPCA 2A	98.068,75	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 agosto / 2018**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	41.136.713,07	0,00	8.000.000,00	33.344.925,25	208.212,18	0,51%	0,02%	0,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	298.213,39	242.187,18	0,00	542.452,04	2.051,47	0,38%	0,02%	0,55%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.666.500,90	0,00	7.693.246,31	0,00	26.745,41	0,35%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.543.550,95	2.605.376,54	0,00	11.185.028,14	36.100,65	0,32%	0,24%	0,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.106.351,50	9.419.930,42	9.191.165,16	7.371.631,34	36.514,58	0,22%	0,00%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.471.708,12	9.614.901,09	0,00	14.116.610,71	30.001,50	0,21%	0,24%	0,41%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.480.964,00	0,00	68.201,38	2.416.740,00	3.977,38	0,16%	4,50%	-2,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	22.190.362,67	0,00	0,00	22.221.439,03	31.076,36	0,14%	0,89%	0,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.800.391,25	0,00	4.222.524,65	5.586.690,62	8.824,02	0,09%	1,40%	-0,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,07	10.936.447,69	10.942.686,51	2.332,48	8.571,23	0,08%	0,00%	0,49%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.145.853,50	0,00	0,00	2.145.933,00	79,50	0,00%	1,39%	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	98.144,14	0,00	0,00	98.068,75	-75,39	-0,08%	1,43%	-0,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.864.580,46	0,00	0,00	38.713.842,10	-150.738,36	-0,39%	1,91%	-0,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.777.748,20	0,00	0,00	6.750.668,13	-27.080,07	-0,40%	3,37%	-0,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.759.245,10	0,00	668.291,34	23.933.710,19	-157.243,57	-0,64%	3,23%	-0,66%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>57.016,89</b>	<b>0,03%</b>	<b>1,32%</b>	

## 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(%)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	4.890.547,67	0,00	5.179.997,96	289.450,29	5,92%	5,98%	14,56%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	6.000.000,00	0,00	6.055.339,19	55.339,19	0,92%	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.008.804,98	8.804,98	0,44%	9,27%	-3,77%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.538.047,95	0,00	0,00	1.537.891,29	-156,66	-0,01%	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.309.895,31	0,00	0,00	1.209.052,77	-100.842,54	-7,70%	13,09%	-7,70%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>252.595,26</b>	<b>1,60%</b>	<b>7,79%</b>	

