

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2018)

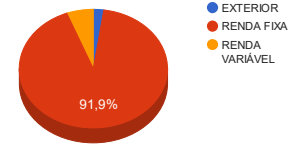
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	101.290,76	0,05%	748	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	40.308.150,40	20,67%	311	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	24.230.173,51	12,42%	1.473	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.488.060,00	1,28%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	25.193.026,72	12,92%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	16.857.861,94	8,64%	1.268	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	7.112.374,13	3,65%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.788.048,55	2,97%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	548.011,92	0,28%	815	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.882.558,09	1,48%	677	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.698,42	0,00%	298	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	27.778.807,96	14,24%	112	2,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	22.746.094,53	11,66%	321	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.215.420,50	1,14%	78	1,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.421.501,35	2,27%	2.074	10,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23 DU	Não há	2.197.422,43	1,13%	55	2,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.368.112,78	0,70%	4.201	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.285.405,97	3,22%	955	1,38%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.537.577,76	0,79%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>194.061.597,72</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			978.539,28				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>195.040.137,00</b>				

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

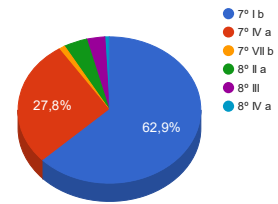
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	122.078.986,01	62,91%	50,00%	65,00%	100,00%	71.982.611,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	116.436.958,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	53.957.170,92	27,80%	0,00%	10,00%	30,00%	4.261.308,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.215.420,50	1,14%	0,00%	4,00%	5,00%	7.487.659,39
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	7.987.036,56	4,12%	0,00%	7,00%	15,00%	21.122.203,10
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.285.405,97	3,24%	0,00%	4,00%	5,00%	3.417.673,92
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.537.577,76	0,79%	0,00%	1,00%	5,00%	8.165.502,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	9.703.079,89
<b>Total Carteira</b>		<b>194.061.597,72</b>					

EXTERIOR	4.421.501,35	2,28%
RENDA FIXA	179.230.116,71	92,36%
RENDA VARIÁVEL	11.388.518,94	5,87%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	122.078.986,01	62,59%	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 "	53.957.170,92	27,66%	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 "	2.215.420,50	1,14%	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 "	7.987.036,56	4,10%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.285.405,97	3,22%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.537.577,76	0,79%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>194.061.597,72</b>	<b>99,50%</b>	<b>50,00</b>	<b>440,00</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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	130.991.631,82	67,16%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.966.852,93	29,72%	0,01%
VINCI PARTNERS	2.197.422,43	1,13%	0,01%
FL Asset Management	1.537.577,76	0,79%	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.368.112,78	0,70%	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	7,14%	10,23%	6,50%	5,19%	10,29%	26,38%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,49%	8,35%	3,55%	4,68%	9,22%	23,60%	0,20%	1,239%	2,05%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,71%	2,30%	0,29%	0,67%	3,32%	11,70%	0,20%	0,747%	4,38%
IMA Geral ex-C	3,43%	7,67%	3,81%	3,83%	8,63%	23,97%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,50%	7,82%	3,71%	3,93%	8,65%	23,07%	0,30%	1,886%	2,83%
IDKA IPCA 2 Anos	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	7,79%	3,21%	3,90%	9,03%	23,32%	0,20%	0,977%	2,33%
IPCA + 6,00% ao ano	0,96%	8,97%	2,34%	5,95%	10,78%	20,57%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,99%	9,05%	4,94%	4,07%	9,59%	25,79%	0,15%	2,713%	5,01%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,06%	6,35%	3,24%	3,80%	7,16%	18,64%	0,20%	0,948%	2,17%
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%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,54%	5,63%	1,87%	3,44%	6,82%	19,01%	0,20%	0,010%	0,29%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,32%	1,58%	3,15%	6,53%	18,49%	0,20%	0,009%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	4,65%	1,37%	2,76%	5,67%	16,44%	0,80%	0,000%	0,02%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	4,43%	1,31%	2,63%	5,41%	16,02%	1,00%	0,003%	0,02%
IPCA	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,77%	8,97%	4,57%	3,91%	9,65%	25,84%	0,20%	2,644%	4,74%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,69%	6,01%	2,50%	2,73%	7,14%	-	0,002	0,740%	1,72%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

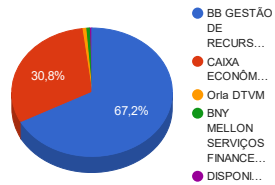
## Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	10,42%	13,90%	10,42%	1,51%	17,03%	34,48%	-	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-14,73%	16,97%	-2,21%	9,90%	24,67%	46,36%	1,60%	9,796%	16,53%
Ibovespa	10,19%	14,43%	10,35%	1,52%	17,65%	34,66%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	12,24%	16,37%	4,44%	-1,71%	18,13%	35,97%	2,00%	16,964%	22,07%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	10,34%	3,83%	5,27%	-5,81%	7,47%	18,75%	1,72%	12,149%	19,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3,11%	-	-	-	-	-	1,60%	1,751%	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

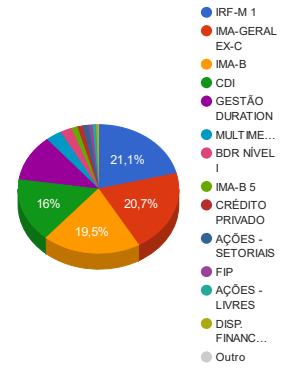


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (outubro / 2018)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	130.991.631,82	67,16%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	60.164.275,36	30,85%
Orla DTVM	1.537.577,76	0,79%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.368.112,78	0,70%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	978.539,28	0,50%

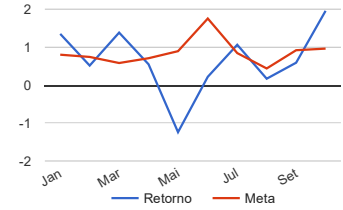
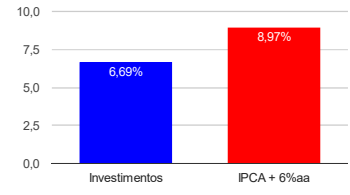


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	41.088.035,45	21,07%
IMA-GERAL EX-C	40.308.150,40	20,67%
IMA-B	38.093.449,40	19,53%
CDI	31.211.076,39	16,00%
GESTÃO DURATION	22.746.094,53	11,66%
MULTIMERCADO	6.285.405,97	3,22%
BDR NÍVEL I	4.421.501,35	2,27%
IMA-B 5	2.488.060,00	1,28%
CRÉDITO PRIVADO	2.215.420,50	1,14%
AÇÕES - SETORIAIS	2.197.422,43	1,13%
FIP	1.537.577,76	0,79%
AÇÕES - LIVRES	1.368.112,78	0,70%
DISP. FINANCEIRA	978.539,28	0,50%
IDKA IPCA 2A	101.290,76	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 outubro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.774.588,06	0,00	0,00	7.112.374,13	337.786,07	4,99%	2,71%	4,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.045.450,76	0,00	0,00	25.193.026,72	1.147.575,96	4,77%	2,64%	4,77%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.946.258,08	0,00	0,00	40.308.150,40	1.361.892,32	3,50%	1,89%	3,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.647.642,31	0,00	0,00	5.788.048,55	140.406,24	2,49%	1,24%	2,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	99.217,38	0,00	0,00	101.290,76	2.073,38	2,09%	0,98%	2,09%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.170.809,00	0,00	0,00	2.215.420,50	44.611,50	2,06%	0,95%	2,06%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.446.208,00	0,00	0,00	2.488.060,00	41.852,00	1,71%	0,75%	1,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	22.367.277,86	0,00	0,00	22.746.094,53	378.816,67	1,69%	0,74%	1,69%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.251.038,00	5.500.000,00	0,00	16.857.861,94	106.823,94	0,64%	0,27%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.125.784,44	7.953.600,18	0,00	24.230.173,51	150.788,89	0,63%	0,27%	0,94%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	33.598.157,44	0,00	6.000.000,00	27.778.807,96	180.650,52	0,54%	0,01%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	545.118,54	0,00	0,00	548.011,92	2.893,38	0,53%	0,01%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.831.361,25	5.661.043,58	10.645.867,57	2.882.558,09	36.020,83	0,27%	0,00%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.341,93	7.950.000,00	7.953.600,18	1.698,42	2.956,67	0,04%	0,00%	0,47%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.935.148,37</b>	<b>2,26%</b>	<b>1,13%</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(%)
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.218.942,62	0,00	0,00	1.368.112,78	149.170,16	12,24%	16,96%	12,24%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.991.507,71	0,00	0,00	2.197.422,43	205.914,72	10,34%	12,15%	10,34%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.096.116,96	0,00	0,00	6.285.405,97	189.289,01	3,11%	1,75%	3,11%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.537.734,52	0,00	0,00	1.537.577,76	-156,76	-0,01%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.185.291,77	0,00	0,00	4.421.501,35	-763.790,42	-14,73%	9,80%	-14,73%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-219.573,29</b>	<b>-1,37%</b>	<b>7,30%</b>	

