

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

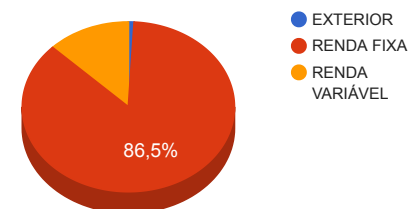
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.723,89	0,06%	371	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.254.834,07	41,04%	741	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	735.511,18	24,06%	1.264	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	532.326,29	17,41%	798	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	40.373,34	1,32%	291	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	78.358,15	2,56%	665	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	21.143,18	0,69%	118	0,01%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	117,58	0,00%	46	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	26.470,43	0,87%	78	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	290.662,76	9,51%	210	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	75.720,00	2,48%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
			TOTAL -	3.057.240,87			

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

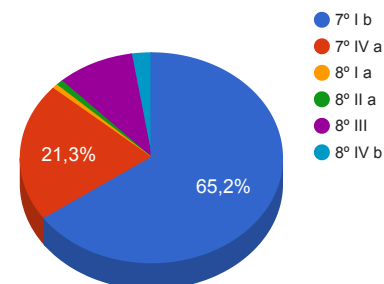
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.992.069,14	65,16%	20,00%	30,00%	70,00%	147.999,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	1.834.344,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	651.057,78	21,30%	5,00%	10,00%	30,00%	266.114,48
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	458.586,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	152.862,04
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	21.143,18	0,69%	2,00%	5,00%	10,00%	284.580,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	26.588,01	0,87%	2,00%	5,00%	10,00%	279.136,08
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	290.662,76	9,51%	7,00%	10,00%	10,00%	15.061,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	152.862,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	75.720,00	2,48%	2,00%	5,00%	5,00%	77.142,04
Total Carteira		3.057.240,87					

EXTERIOR	26.470,43	0,87%
RENTA FIXA	2.643.126,92	86,45%
RENTA VARIÁVEL	387.643,52	12,68%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.992.069,14	65,16%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	651.057,78	21,30%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	21.143,18	0,69%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	26.588,01	0,87%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	290.662,76	9,51%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	75.720,00	2,48%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	3.057.240,87	100,00%	54,00	225,00

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	2.914.677,10	95,34%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	142.563,77	4,66%	0,00%

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

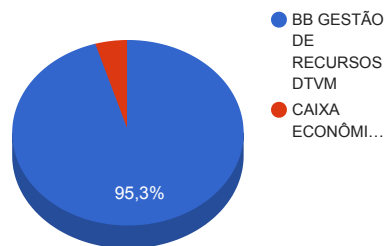
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	4,26%	1,58%	3,18%	6,86%	19,86%	0,20%	0,018%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,49%	3,74%	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%
IRF-M 1	0,44%	4,21%	1,65%	3,04%	6,90%	20,96%	-	-	-
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 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,26%	3,93%	1,63%	2,05%	6,45%	21,07%	0,20%	1,968%	2,82%

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

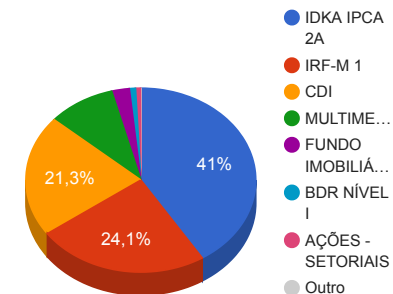
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	13,10%	35,75%	18,54%	35,26%	56,13%	77,70%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	12,88%	33,66%	17,82%	33,50%	52,90%	71,68%	0,70%	5,931%	15,02%
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,51%	3,86%	1,10%	2,92%	7,00%	20,78%	0,60%	2,298%	2,93%
Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-2,28%	3,47%	1,62%	-7,08%	12,80%	27,38%	1,00%	10,251%	19,06%
IGC	-2,54%	-3,65%	0,50%	-10,67%	2,40%	26,28%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-3,26%	-3,03%	0,09%	-10,00%	2,71%	25,87%	1,00%	11,022%	18,29%
IFIX	-0,70%	-3,91%	-3,37%	-7,44%	2,66%	21,07%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,41%	-11,54%	-8,82%	-16,83%	-7,11%	-4,74%	1,20%	9,122%	22,06%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.914.677,10	95,34%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	142.563,77	4,66%



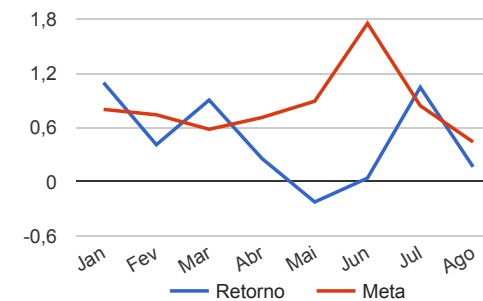
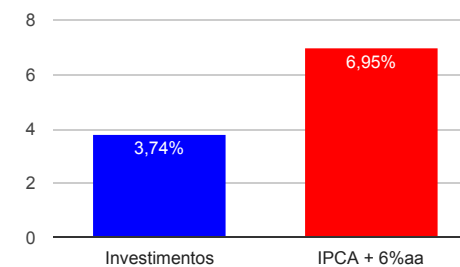
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	1.254.834,07	41,04%
IRF-M 1	735.511,18	24,06%
CDI	651.057,78	21,30%
MULTIMERCADO	290.662,76	9,51%
FUNDO IMOBILIÁRIO	75.720,00	2,48%
BDR NÍVEL I	26.470,43	0,87%
AÇÕES - SETORIAIS	21.143,18	0,69%
IMA-B 5	1.723,89	0,06%
AÇÕES - LIVRES	117,58	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	2.980.076,96	269.728,81	416.522,43	2.865.909,74	32.626,40	1,09%	0,80%	136,60%	0,72%
Fevereiro	2.865.909,74	338.963,62	358.967,43	2.857.648,92	11.742,99	0,41%	0,74%	55,49%	0,88%
Março	2.857.648,92	898.186,92	852.054,16	2.930.007,61	26.225,93	0,90%	0,58%	156,48%	0,75%
Abril	2.930.007,61	551.729,83	514.579,85	2.974.803,18	7.645,59	0,26%	0,71%	36,40%	0,61%
Mai	2.974.803,18	1.638.307,34	1.527.669,28	3.078.563,59	-6.877,65	-0,22%	0,89%	-25,08%	1,12%
Junho	3.078.563,59	984.482,01	1.028.428,58	3.035.881,58	1.264,56	0,04%	1,75%	2,34%	1,78%
Julho	3.035.881,58	730.491,25	611.987,79	3.187.303,55	32.918,51	1,04%	0,84%	123,99%	0,76%
Agosto	3.187.303,55	939.735,68	1.075.080,82	3.057.240,87	5.282,46	0,17%	0,44%	37,43%	1,22%
Acumulado no ano					110.828,79	3,74%	6,95%	53,89%	

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(%)
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	39.659,06	560,00	42,00	40.373,34	196,28	0,49%	0,00%	0,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	442.854,28	87.000,00	0,00	532.326,29	2.472,01	0,47%	0,02%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	967.252,32	64.535,71	300.000,00	735.511,18	3.723,15	0,36%	0,24%	0,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	151.703,35	100.639,97	174.478,82	78.358,15	493,65	0,20%	0,00%	0,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.168.135,87	687.000,00	600.000,00	1.254.834,07	-301,80	-0,02%	1,43%	-0,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.728,34	0,00	0,00	1.723,89	-4,45	-0,26%	1,97%	-0,26%
Total Renda Fixa					6.578,84	0,24%	0,75%	

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(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	23.449,22	0,00	0,00	26.470,43	3.021,21	12,88%	5,93%	12,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	292.153,88	0,00	0,00	290.662,76	-1.491,12	-0,51%	2,30%	-0,51%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	78.389,60	0,00	560,00	75.720,00	-2.109,60	-2,69%	9,12%	-3,41%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	121,36	0,00	0,00	117,58	-3,78	-3,11%	10,25%	-2,28%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	21.856,27	0,00	0,00	21.143,18	-713,09	-3,26%	11,02%	-3,26%
Total Renda Variável					-1.296,38	-0,31%	4,23%	