

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2018



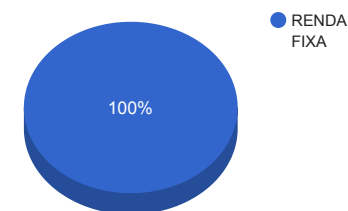
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

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	3.227.015,35	16,30%	370	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.472.020,86	27,64%	1.471	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.123.565,39	20,83%	674	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.807.191,56	9,13%	701	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.145.681,56	5,79%	449	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.836,74	0,01%	670	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.238.879,01	11,31%	822	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.783.301,21	9,01%	294	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	19.800.491,68				

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

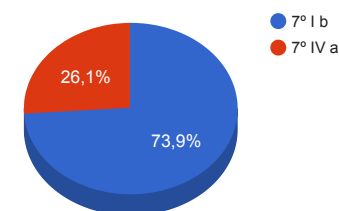
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	14.629.793,16	73,89%	15,00%	25,00%	100,00%	5.170.698,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	11.880.295,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	5.170.698,52	26,11%	5,00%	10,00%	40,00%	2.749.498,15
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	2.970.073,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	990.024,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	990.024,58
Total Renda Fixa	100,00%	19.800.491,68	100,00%	36,00	70,00	230,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	1.980.049,17
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	1.980.049,17
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	1.980.049,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	990.024,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	990.024,58
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	15,00	30,00	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	14.629.793,16	73,89%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	5.170.698,52	26,11%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
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%
Total Renda Fixa	19.800.491,68	100,00%	36,00	230,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	0,00	0,00%	15,00	40,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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)

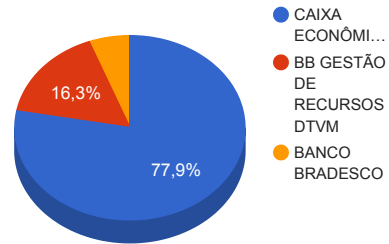
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.424.958,03	77,90%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.229.852,09	16,31%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.145.681,56	5,79%	0,00%

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

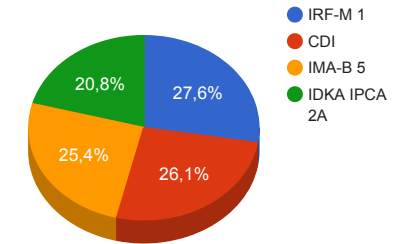
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	5,71%	2,36%	2,56%	7,66%	21,41%	0,20%	0,875%	2,27%
IMA-B 5	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,87%	4,83%	2,07%	1,31%	6,32%	20,44%	0,20%	1,232%	2,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	4,79%	2,05%	1,27%	6,28%	20,38%	0,20%	1,241%	2,90%
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	1,69%	2,89%	6,57%	19,83%	0,20%	0,154%	0,52%
Selic	0,47%	4,82%	1,59%	3,18%	6,66%	18,97%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	4,74%	1,56%	3,10%	6,58%	19,58%	0,20%	0,007%	0,04%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	4,65%	1,53%	3,08%	6,48%	18,78%	0,20%	0,020%	0,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,40%	4,16%	1,37%	2,74%	5,79%	17,03%	0,80%	0,000%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	3,97%	1,31%	2,61%	5,52%	16,64%	1,00%	0,003%	0,03%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.424.958,03	77,90%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.229.852,09	16,31%
BANCO BRADESCO	1.145.681,56	5,79%



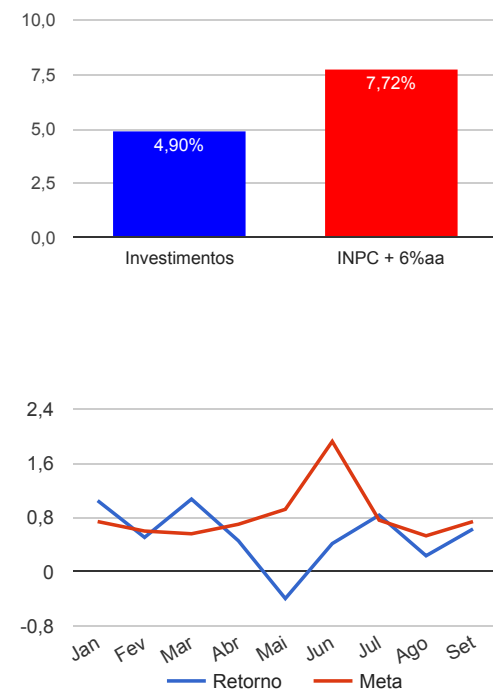
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	5.472.020,86	27,64%
CDI	5.170.698,52	26,11%
IMA-B 5	5.034.206,91	25,42%
IDKA IPCA 2A	4.123.565,39	20,83%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	13.308.159,65	1.900.000,00	0,00	15.367.553,69	159.394,04	1,05%	0,74%	141,41%	0,44%
Fevereiro	15.367.553,69	0,00	600.000,00	14.845.445,45	77.891,76	0,51%	0,60%	84,78%	0,56%
Março	14.845.445,45	3.600.000,00	0,00	18.642.902,97	197.457,52	1,07%	0,56%	192,16%	0,63%
Abril	18.642.902,97	2.000.000,00	100.000,00	20.636.691,16	93.788,19	0,46%	0,70%	65,43%	0,25%
Mai	20.636.691,16	1.700.900,00	2.000.000,00	20.256.434,54	-81.156,62	-0,39%	0,92%	-42,80%	0,58%
Junho	20.256.434,54	1.574.568,01	1.402.789,89	20.513.111,45	84.898,79	0,42%	1,92%	21,60%	1,18%
Julho	20.513.111,45	1.684.639,56	2.545.798,75	19.822.949,81	170.997,55	0,83%	0,76%	109,50%	0,34%
Agosto	19.822.949,81	6.240.568,04	6.539.399,16	19.570.990,03	46.871,34	0,24%	0,53%	44,34%	0,72%
Setembro	19.570.990,03	4.180.094,81	4.074.637,76	19.800.491,68	124.044,60	0,63%	0,74%	85,01%	0,54%
Acumulado no ano					874.187,17	4,90%	7,72%	63,49%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.199.329,25	0,00	0,00	3.227.015,35	27.686,10	0,87%	1,23%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.791.839,41	0,00	0,00	1.807.191,56	15.352,15	0,86%	1,24%	0,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.439.994,44	0,00	0,00	5.472.020,86	32.026,42	0,59%	0,15%	0,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.099.914,83	2.000.000,00	0,00	4.123.565,39	23.650,56	0,58%	0,88%	1,15%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.140.377,02	0,00	0,00	1.145.681,56	5.304,54	0,47%	0,01%	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.221.064,39	0,00	2.000.000,00	2.238.879,01	17.814,62	0,42%	0,02%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.825,79	0,00	0,00	2.836,74	10,95	0,39%	0,00%	0,39%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.675.644,90	2.180.094,81	2.074.637,76	1.783.301,21	2.199,26	0,06%	0,00%	0,40%
Total Renda Fixa					124.044,60	0,63%	0,54%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.347.375,47	0,00	5.200.000,00	2.238.879,01	91.503,54	1,43%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.106.083,04	2.300.000,00	0,00	5.472.020,86	65.937,82	1,51%	1,69%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.161.472,77	0,00	0,00	3.227.015,35	65.542,58	2,07%	2,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.075.125,14	2.000.000,00	0,00	4.123.565,39	48.440,25	1,78%	2,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.118.384,94	0,00	350.000,00	1.807.191,56	38.806,62	1,93%	2,05%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.128.113,11	0,00	0,00	1.145.681,56	17.568,45	1,56%	1,56%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.573.756,93	7.805.302,41	7.609.835,67	1.783.301,21	14.077,54	0,36%	1,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.800,05	0,00	0,00	2.836,74	36,69	1,31%	1,31%
Total Renda Fixa					341.913,49	1,71%	