

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.

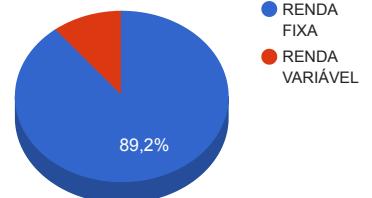


Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

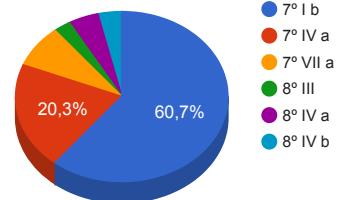
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.409.483,31	4,38%	1.268	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.809.712,02	26,90%	748	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.591.847,53	2,89%	693	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.636.333,71	26,58%	1.473	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.622.987,16	2,95%	15.695	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	274.757,68	0,50%	815	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	281.382,77	0,51%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	33.749,93	0,06%	677	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.081.305,10	14,68%	437	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	893.583,27	1,62%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.653.251,71	3,00%	34	0,73%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	761.997,28	1,38%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	2.052.154,29	3,73%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	17.910,03	0,03%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.406.362,57	2,55%			Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.528.867,48	4,59%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.030.646,98	1,87%		6,94%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	975.483,81	1,77%		0,50%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
			TOTAL -	55.061.816,63			

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	33.447.376,57	60,75%	15,00%	25,00%	70,00%	5.095.895,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	33.037.089,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.187.765,91	20,32%	5,00%	10,00%	30,00%	5.330.779,08
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	8.259.272,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.467.403,28	8,11%	2,00%	5,00%	5,00%	-1.714.312,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.753.090,83
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.753.090,83
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.753.090,83
Total Renda Fixa	100,00%	49.102.545,76	89,18%	40,00	80,00	200,00	-

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%	5.506.181,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	5.506.181,66
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.424.272,60	2,59%	7,00%	10,00%	10,00%	4.081.909,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.528.867,48	4,59%	2,00%	5,00%	5,00%	224.223,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.006.130,79	3,64%	2,00%	5,00%	5,00%	746.960,04
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.753.090,83
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.753.090,83
Total Renda Variável	30,00%	5.959.270,87	10,82%	19,00	40,00	50,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução


Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	33.447.376,57	60,75%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.187.765,91	20,32%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.467.403,28	8,11%	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%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	49.102.545,76	89,18%	40,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 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	1.424.272,60	2,59%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.528.867,48	4,59%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.006.130,79	3,64%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	5.959.270,87	10,82%	19,00	50,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.932.473,50	47,10%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.527.702,94	31,83%	0,00%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	2.832.061,60	5,14%	0,22%
A5 CAPITAL PARTNERS	2.528.867,48	4,59%	-
FMD ASSET	1.406.362,57	2,55%	79,40%
Única Administradora	1.174.966,04	2,13%	0,09%
Elleven Gestora de Recursos	1.030.646,98	1,87%	0,19%
ZION Invest	975.483,81	1,77%	0,20%

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 5	3,10%	8,23%	3,75%	4,10%	9,30%	24,04%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,44%	-9,73%	1,46%	-11,20%	-7,18%	-0,98%	0,70%	0,911%	8,54%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,02%	-18,75%	0,68%	-15,97%	-18,73%	-12,89%	0,70%	0,725%	14,75%
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,08%	7,91%	3,27%	3,89%	9,10%	23,42%	0,20%	0,971%	2,33%
IPCA + 8,00% ao ano	1,13%	10,68%	2,83%	6,96%	12,85%	25,13%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-	0,35%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano	1,05%	9,83%	2,59%	6,46%	11,82%	22,84%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	9,32%	-17,52%	1,34%	-0,40%	-18,07%	-12,81%	1,65%	11,615%	17,51%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,00%	1.104,66%	1.800,00%	1.171,78%	-4,94%	-46,58%	0,00%	-	-
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	5,17%	1,53%	3,06%	6,34%	18,07%	0,20%	0,033%	0,07%
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%

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

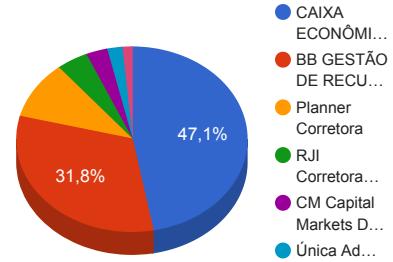
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	4,43%	1,31%	2,63%	5,41%	16,02%	1,00%	0,003%	0,02%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,10%	1,07%	0,30%	0,60%	1,38%	7,17%	5,00%	0,000%	0,02%

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

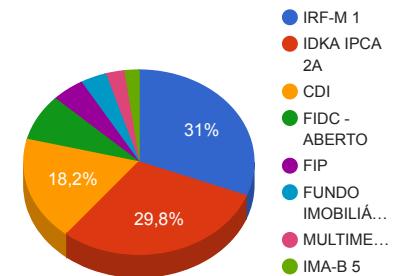
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	5,04%	0,72%	4,08%	-4,06%	0,73%	18,90%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,96%	8,97%	2,34%	5,95%	10,78%	20,57%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-100,00%	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	1,50%	-	-
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,21%	-94,89%	-95,04%	-95,02%	-94,79%	-96,28%	0,00%	6,097%	95,47%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	0,00%	-14,09%	-5,50%	-15,25%	-4,55%	26,85%	1,60%	21,243%	93,51%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.932.473,50	47,10%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.527.702,94	31,83%
Planner Corretora	5.556.505,58	10,09%
RJI Corretora de Valores	2.437.009,55	4,43%
CM Capital Markets DTVM	1.653.251,71	3,00%
Única Administradora	1.174.966,04	2,13%
Orla DTVM	779.907,31	1,42%

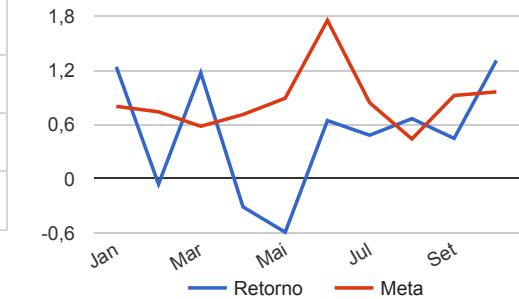
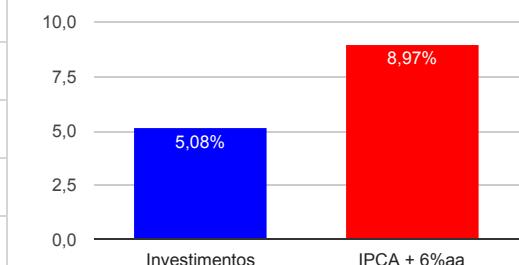


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	17.045.817,02	30,96%
IDKA IPCA 2A	16.401.559,55	29,79%
CDI	10.012.799,87	18,18%
FIDC - ABERTO	4.467.403,28	8,11%
FIP	2.528.867,48	4,59%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.006.130,79	3,64%
MULTIMERCADO	1.424.272,60	2,59%
IMA-B 5	1.174.966,04	2,13%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	50.432.478,90	996.441,07	773.301,47	51.281.933,71	626.315,21	1,24%	0,80%	154,27%	0,88%
Fevereiro	51.281.933,71	378.339,14	287.553,11	51.342.483,08	-30.236,66	-0,06%	0,74%	-7,97%	1,65%
Março	51.342.483,08	379.735,04	168.673,89	52.157.009,92	603.465,69	1,17%	0,58%	202,80%	2,04%
Abril	52.157.009,92	433.058,47	239.530,48	52.188.139,40	-162.398,51	-0,31%	0,71%	-43,83%	2,36%
Maio	52.188.139,40	1.367.786,44	1.182.668,58	52.064.336,70	-308.920,56	-0,59%	0,89%	-66,37%	1,80%
Junho	52.064.336,70	423.088,50	193.644,49	52.630.028,36	336.247,65	0,64%	1,75%	36,68%	3,08%
Julho	52.630.028,36	405.335,23	190.754,95	53.099.032,10	254.423,46	0,48%	0,84%	57,20%	2,26%
Agosto	53.099.032,10	424.554,33	199.232,29	53.678.666,24	354.312,10	0,66%	0,44%	150,07%	1,71%
Setembro	53.678.666,24	451.981,49	214.222,72	54.157.119,79	240.694,78	0,45%	0,92%	48,40%	1,21%
Outubro	54.157.119,79	403.488,12	208.752,90	55.061.816,63	709.961,62	1,31%	0,96%	135,74%	1,31%
Acumulado no ano					2.623.864,78	5,08%	8,97%	56,65%	

Acumulado no Ano


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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.512.301,15	0,00	0,00	1.653.251,71	140.950,56	9,32%	11,61%	9,32%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.506.564,32	0,00	0,00	14.809.712,02	303.147,70	2,09%	0,98%	2,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.559.339,34	0,00	0,00	1.591.847,53	32.508,19	2,08%	0,97%	2,08%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	277.386,63	0,00	0,00	281.382,77	3.996,14	1,44%	0,91%	1,44%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.029.227,96	0,00	0,00	2.052.154,29	22.926,33	1,13%	-	-
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	884.593,41	0,00	0,00	893.583,27	8.989,86	1,02%	0,72%	1,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.500.740,25	0,00	0,00	14.636.333,71	135.593,46	0,94%	0,27%	0,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.387.167,28	0,00	0,00	2.409.483,31	22.316,03	0,93%	0,27%	0,93%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.037.958,39	0,00	0,00	8.081.305,10	43.346,71	0,54%	0,03%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	273.307,02	0,00	0,00	274.757,68	1.450,66	0,53%	0,01%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.598,87	0,00	0,00	33.749,93	151,06	0,45%	0,00%	0,45%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.426.644,31	403.488,12	208.752,90	1.622.987,16	1.607,63	0,09%	0,00%	0,10%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	763.748,63	0,00	0,00	761.997,28	-1.751,35	-0,23%	-	-
Total Renda Fixa						715.232,98	1,48%	0,89%

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	17.696,18	0,00	0,00	17.910,03	213,85	1,21%	6,10%	1,21%
HAZ FII - ATCR11	1.030.074,00	0,00	0,00	1.030.646,98	572,98	0,06%	-	0,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	975.483,81	0,00	0,00	975.483,81	0,00	0,00%	21,24%	0,00%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.407.945,49	0,00	0,00	1.406.362,57	-1.582,92	-0,11%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.533.342,75	0,00	0,00	2.528.867,48	-4.475,27	-0,18%	-	-
				Total Renda Variável	-5.271,36	-0,09%	20,97%	