

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018



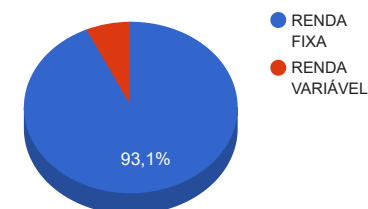
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	59.717.278,91	16,31%	1.457	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	5.279.447,92	1,44%	109	2,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.261.418,33	5,81%	715	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.774.028,06	1,85%	1.264	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.627.740,56	0,99%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	111.958.838,53	30,58%	674	1,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.638.949,63	3,73%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	30.445.030,10	8,32%	809	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	78.914.238,98	21,56%	300	3,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	9.065.887,02	2,48%	74	1,78%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	5.310.464,62	1,45%	36	7,74%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	6.127.546,82	1,67%	88	3,61%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.041.638,83	0,28%	118	0,40%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.817.698,89	0,50%	2.593	1,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	5.173.030,00	1,41%	729	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	3.026.562,96	0,83%	956	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	2.917.445,77	0,80%		0,12%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			366.097.245,93				

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

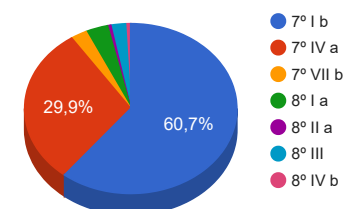
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	222.257.701,94	60,71%	15,00%	25,00%	70,00%	34.010.370,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	219.658.347,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	109.359.269,08	29,87%	5,00%	10,00%	30,00%	469.904,70
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	54.914.586,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.304.862,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	9.065.887,02	2,48%	2,00%	5,00%	5,00%	9.238.975,28
Total Renda Fixa	100,00%	340.682.858,04	93,06%	36,00	70,00	190,00	-

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%	12.479.650,27	3,41%	2,00%	5,00%	10,00%	24.130.074,32
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.817.698,89	0,50%	2,00%	5,00%	10,00%	34.792.025,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.199.592,96	2,24%	7,00%	10,00%	10,00%	28.410.131,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.304.862,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.917.445,77	0,80%	2,00%	5,00%	5,00%	15.387.416,53
Total Renda Variável	30,00%	25.414.387,89	6,94%	15,00	30,00	40,00	-

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 "	222.257.701,94	60,71%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	109.359.269,08	29,87%	5,00%	30,00%
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 "	9.065.887,02	2,48%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	340.682.858,04	93,06%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	12.479.650,27	3,41%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.817.698,89	0,50%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	8.199.592,96	2,24%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.917.445,77	0,80%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	25.414.387,89	6,94%	15,00	40,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	321.934.409,25	87,94%	0,08%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.245.390,91	11,27%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.917.445,77	0,80%	0,19%

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,56%	4,19%	1,59%	3,15%	6,68%	19,56%	0,20%	0,006%	0,05%
IPCA + 6,00% ao ano	0,44%	6,95%	3,06%	5,32%	10,39%	19,86%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	10,42%	6,35%	8,57%	13,62%	23,75%	0,20%	2,616%	4,16%
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 TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,41%	2,24%	4,08%	7,60%	20,32%	0,20%	0,142%	0,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	4,50%	1,41%	2,93%	7,39%	21,63%	0,20%	1,406%	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%
IMA-B 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,27%	3,90%	1,61%	2,01%	6,42%	21,03%	0,20%	1,979%	2,83%
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 IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,36%	5,40%	2,39%	3,38%	8,45%	26,33%	0,20%	1,888%	2,87%

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
ICON	-4,99%	-17,18%	-3,35%	-15,26%	-10,84%	2,13%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-5,00%	-17,47%	-3,42%	-15,55%	-11,76%	-0,16%	1,00%	10,541%	18,26%

Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,42%	-	0,44%	2,05%	-	-	1,60%	1,364%	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-3,14%	0,14%	-0,16%	-10,27%	7,71%	31,30%	0,50%	11,163%	19,58%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	-	-	-	-	-	-	1,60%	-	-

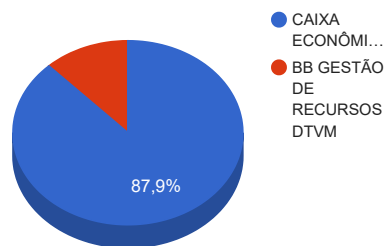
IBX-50	-3,08%	0,65%	-0,03%	-10,29%	8,57%	32,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-3,30%	-0,02%	-0,47%	-11,29%	9,25%	30,84%	0,70%	11,170%	20,10%

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%

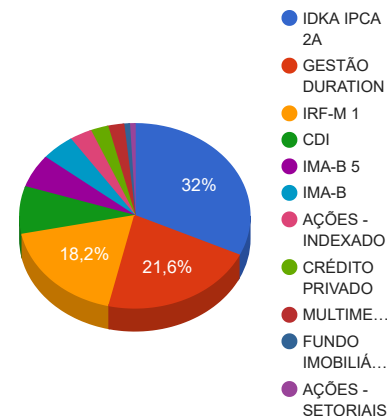
IFIX	-0,70%	-3,91%	-3,37%	-7,44%	2,66%	21,07%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	321.934.409,25	87,94%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.162.836,68	12,06%



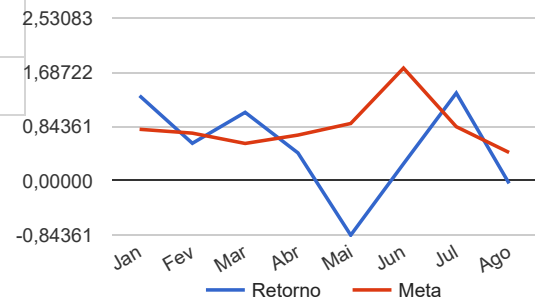
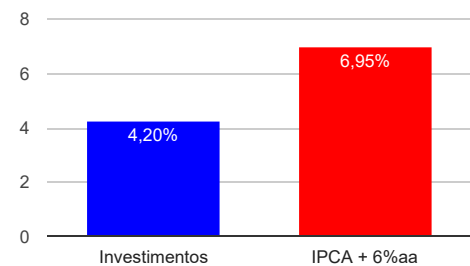
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	117.238.286,45	32,02%
GESTÃO DURATION	78.914.238,98	21,56%
IRF-M 1	66.491.306,97	18,16%
CDI	30.445.030,10	8,32%
IMA-B 5	21.261.418,33	5,81%
IMA-B	17.266.690,19	4,72%
AÇÕES - INDEXADO	11.438.011,44	3,12%
CRÉDITO PRIVADO	9.065.887,02	2,48%
MULTIMERCADO	8.199.592,96	2,24%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.917.445,77	0,80%
AÇÕES - SETORIAIS	2.859.337,72	0,78%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	331.118.244,39	79.160.099,48	77.138.165,90	337.541.570,08	4.401.392,11	1,32%	0,80%	164,84%	0,58%
Fevereiro	337.541.570,08	6.833.180,96	3.613.681,45	342.746.002,72	1.984.933,13	0,58%	0,74%	78,89%	0,91%
Março	342.746.002,72	5.623.578,09	3.969.500,00	348.061.351,69	3.661.270,88	1,06%	0,58%	184,18%	0,69%
Abril	348.061.351,69	4.583.420,32	2.557.000,00	351.604.882,35	1.517.110,34	0,43%	0,71%	61,22%	0,48%
Mai	351.604.882,35	10.891.075,25	5.200.600,00	354.281.178,25	-3.014.179,35	-0,84%	0,89%	-94,93%	1,21%
Junho	354.281.178,25	4.569.095,76	2.655.470,00	357.137.798,07	942.994,06	0,26%	1,75%	15,10%	2,00%
Julho	357.137.798,07	38.213.584,77	36.015.327,98	364.233.250,42	4.897.195,56	1,36%	0,84%	161,92%	0,91%
Agosto	364.233.250,42	102.353.814,40	100.343.029,95	366.097.245,93	-146.788,94	-0,04%	0,44%	-9,05%	1,42%
Acumulado no ano					14.243.927,79	4,20%	6,95%	60,45%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.247.677,25	0,00	0,00	5.279.447,92	31.770,67	0,61%	0,14%	0,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	65.170.164,95	0,00	35.000.000,00	30.445.030,10	274.865,15	0,42%	0,01%	0,56%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.690.935,86	0,00	21.766.607,00	0,00	75.671,14	0,35%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.558.134,03	17.272.310,95	2.320.088,00	59.717.278,91	206.921,93	0,33%	0,24%	0,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.714.126,97	390.790,51	7.376.511,59	6.774.028,06	45.622,17	0,32%	0,24%	0,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	53.803.408,32	25.000.000,00	0,00	78.914.238,98	110.830,66	0,14%	0,89%	0,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.363.924,41	0,00	2.741.913,76	3.627.740,56	5.729,91	0,09%	1,40%	-0,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	59.490.377,77	52.575.080,97	0,00	111.958.838,53	-106.620,21	-0,10%	1,41%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.319.034,92	0,00	0,00	21.261.418,33	-57.616,59	-0,27%	1,98%	-0,27%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	9.099.077,04	0,00	0,00	9.065.887,02	-33.190,02	-0,36%	1,89%	-0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.119.965,22	0,00	405.535,05	13.638.949,63	-75.480,54	-0,53%	2,62%	-0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.930.073,60	0,00	30.732.374,55	0,00	-197.699,05	-0,64%	2,26%	-1,08%
Total Renda Fixa					280.805,22	0,08%	1,01%	

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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.026.562,96	26.562,96	0,89%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.194.975,00	0,00	0,00	5.173.030,00	-21.945,00	-0,42%	1,36%	-0,42%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	2.097.678,00	4.115.631,97	0,00	6.127.546,82	-85.763,15	-1,38%	11,17%	-3,30%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.960.979,20	0,00	0,00	2.917.445,77	-43.533,43	-1,47%	-	0,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	5.482.565,00	0,00	0,00	5.310.464,62	-172.100,38	-3,14%	11,16%	-3,14%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.076.769,77	0,00	0,00	1.041.638,83	-35.130,94	-3,26%	11,02%	-3,26%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1.913.383,11	0,00	0,00	1.817.698,89	-95.684,22	-5,00%	10,54%	-5,00%
Total Renda Variável					-427.594,16	-1,65%	8,50%	