

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2018)

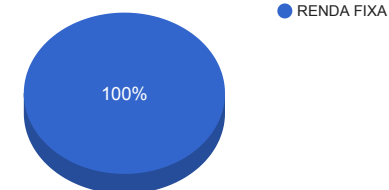
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			916.557,43	7,03%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.092.150,74	16,04%	711	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.650.492,18	20,33%	1.269	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.463.216,43	26,56%	756	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.067.857,73	15,86%	1.472	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.060,43	0,01%	677	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.848.109,53	14,17%	329	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		Total	13.039.444,47				

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

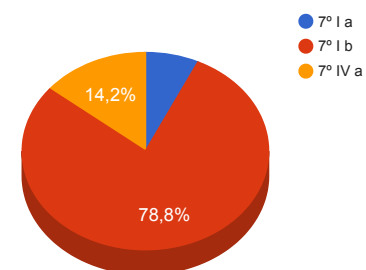
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	916.557,43	7,03%	7,10%	8,00%	20,00%	1.691.331,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	10.273.717,08	78,79%	60,00%	70,00%	100,00%	2.765.727,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	60,00%	7.823.666,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	1.849.169,96	14,18%	12,00%	15,00%	30,00%	2.062.663,38
Total Carteira		13.039.444,47					

RENDA FIXA	13.039.444,47	100,00%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: novembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	916.557,43	7,03%	7,10%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	10.273.717,08	78,79%	60,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	6,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.849.169,96	14,18%	12,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	13.039.444,47	100,00%	79,10	201,00

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

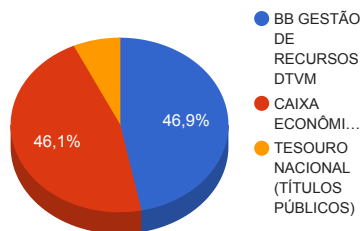
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.114.769,04	46,89%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.008.118,00	46,08%	0,00%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	916.557,43	7,03%	-

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

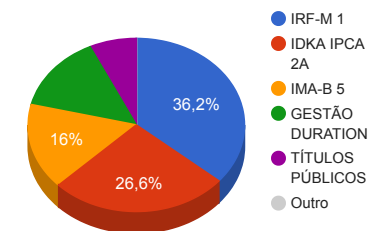
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,54%	6,38%	2,08%	3,77%	6,98%	19,62%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	6,23%	2,07%	3,69%	6,83%	19,23%	0,20%	0,073%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,19%	2,06%	3,67%	6,78%	19,10%	0,10%	0,073%	0,55%
CDI	0,49%	5,90%	1,51%	3,17%	6,47%	17,72%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	4,86%	1,25%	2,62%	5,33%	15,36%	1,00%	0,003%	0,02%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	8,40%	3,51%	5,44%	9,65%	24,73%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	7,90%	3,40%	4,89%	8,83%	22,80%	0,20%	0,695%	2,35%
IMA-B 5	0,14%	8,39%	4,16%	5,90%	9,35%	23,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	8,18%	4,12%	5,80%	9,12%	23,25%	0,20%	0,927%	3,05%
IPCA	-0,21%	3,59%	0,72%	2,23%	4,05%	6,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,37%	6,40%	2,74%	4,33%	7,25%	19,88%	0,002	0,980%	1,78%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.114.769,04	46,89%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.008.118,00	46,08%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	916.557,43	7,03%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.718.349,91	36,19%
IDKA IPCA 2A	3.463.216,43	26,56%
IMA-B 5	2.092.150,74	16,04%
GESTÃO DURATION	1.848.109,53	14,17%
TÍTULOS PÚBLICOS	916.557,43	7,03%
CDI	1.060,43	0,01%



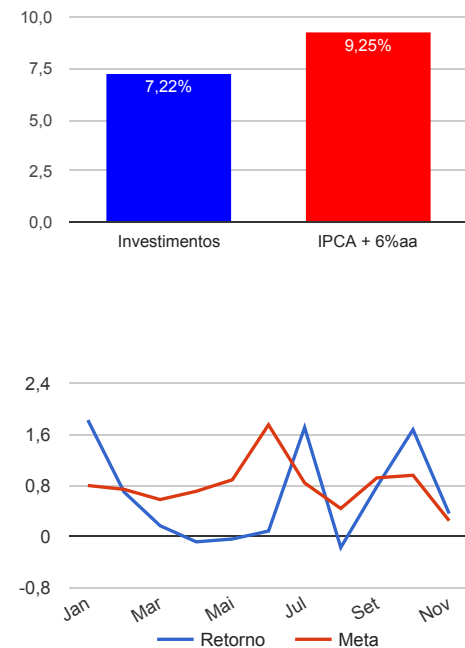
Carteira de Títulos Públicos - base (novembro / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2021	16/07/2010	850	932,47882400	1.078,302864	792.607,00	916.557,43

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	12.282.591,78	178.000,00	141.800,00	12.543.440,23	224.648,45	1,82%	0,80%	227,53%	2,11%
Fevereiro	12.543.440,23	110.000,00	154.782,27	12.586.312,06	87.654,10	0,70%	0,74%	94,64%	1,83%
Março	12.586.312,06	133.000,00	161.000,00	12.579.777,29	21.465,23	0,17%	0,58%	29,55%	1,19%
Abril	12.579.777,29	130.000,00	154.100,00	12.545.405,95	-10.271,34	-0,08%	0,71%	-11,54%	1,33%
Mai	12.545.405,95	134.000,00	156.258,50	12.518.517,58	-4.629,87	-0,04%	0,89%	-4,15%	0,49%
Junho	12.518.517,58	123.469,60	149.700,00	12.503.180,60	10.893,42	0,09%	1,75%	4,96%	4,16%
Julho	12.503.180,60	126.000,00	176.118,55	12.666.650,82	213.588,77	1,71%	0,84%	202,96%	2,49%
Agosto	12.666.650,82	5.861.000,00	5.847.101,75	12.658.896,74	-21.652,33	-0,17%	0,44%	-38,57%	0,80%
Setembro	12.658.896,74	178.000,00	166.500,00	12.769.621,88	99.225,14	0,78%	0,92%	84,90%	0,50%
Outubro	12.769.621,88	1.370.000,00	1.368.000,00	12.985.550,88	213.929,00	1,68%	0,96%	174,07%	0,77%
Novembro	12.985.550,88	170.000,00	163.000,00	13.039.444,47	46.893,59	0,36%	0,25%	142,91%	0,54%
Acumulado no ano					881.744,16	7,22%	9,25%	78,02%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TÍTULOS PÚBLICOS	907.963,66	0,00	0,00	916.557,43	8.593,77	0,95%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.056.989,75	0,00	0,00	2.067.857,73	10.867,98	0,53%	0,07%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.798.994,89	0,00	163.000,00	2.650.492,18	14.497,29	0,52%	0,07%	0,52%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.056,13	0,00	0,00	1.060,43	4,30	0,41%	0,00%	0,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.841.208,00	0,00	0,00	1.848.109,53	6.901,53	0,37%	0,98%	0,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.089.335,10	0,00	0,00	2.092.150,74	2.815,64	0,13%	0,93%	0,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.290.003,35	170.000,00	0,00	3.463.216,43	3.213,08	0,09%	0,69%	0,11%
Total Renda Fixa					46.893,59	0,36%	0,54%	