

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2018

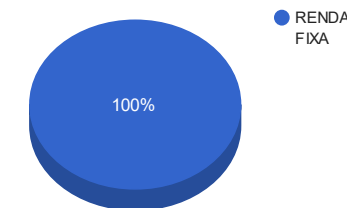
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.209,14	0,03%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.392.843,42	35,16%	1.438	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.912.188,06	3,87%	218	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.991.816,74	10,09%	661	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.128.955,07	10,37%	711	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.148.704,34	8,39%	29	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.947.830,58	5,96%	1.252	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.110.053,50	2,24%	269	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.582.587,66	7,24%	3.231	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.526.035,29	5,11%	435	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.708.997,92	11,54%	761	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	49.463.221,72				

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

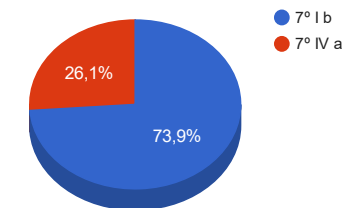
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	36.522.338,21	73,84%	0,00%	80,00%	100,00%	12.940.883,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	29.677.933,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	12.927.674,37	26,14%	0,00%	15,00%	40,00%	6.857.614,32
Total Renda Fixa	100,00%	49.450.012,58	99,97%	0,00	100,00	200,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00	35,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	36.522.338,21	73,84%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.927.674,37	26,14%	0,00%	40,00%
Total Renda Fixa	49.450.012,58	99,97%	0,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	0,00	0,00%	0,00	35,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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	31.149.704,02	62,98%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.656.828,50	17,50%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	4.148.704,34	8,39%	0,00%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	3.582.587,66	7,24%	0,04%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.912.188,06	3,87%	0,00%

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

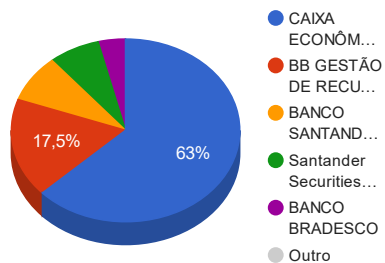
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-0,32%	1,16%	-3,61%	1,16%	8,20%	22,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,36%	1,03%	-3,68%	1,03%	7,92%	22,14%	0,20%	3,952%	4,56%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

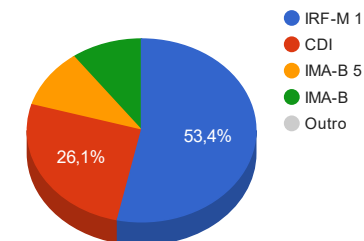
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,32%	3,50%	-1,23%	0,09%	6,45%	22,38%	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.149.704,02	62,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.656.828,50	17,50%
BANCO SANTANDER	4.148.704,34	8,39%
Santander Securities Services	3.582.587,66	7,24%
BANCO BRADESCO	1.912.188,06	3,87%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	13.209,14	0,03%

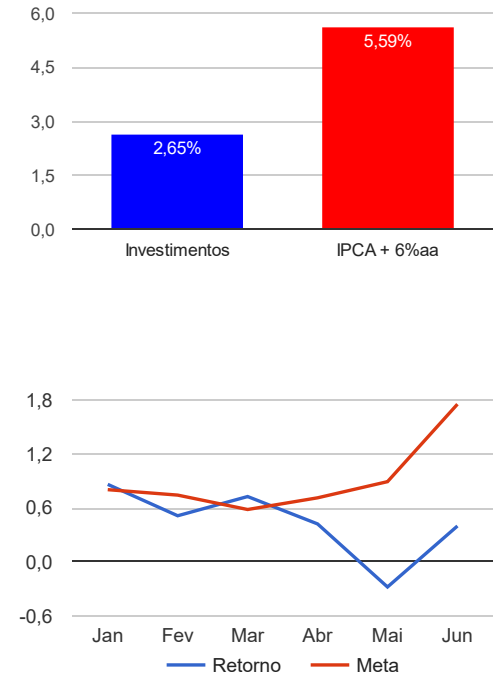


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	26.401.566,40	53,38%
CDI	12.927.674,37	26,14%
IMA-B 5	5.128.955,07	10,37%
IMA-B	4.991.816,74	10,09%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	13.209,14	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.648.256,42	254.374,77	0,00	1.912.188,06	9.556,87	0,50%	0,69%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.680.535,42	0,00	0,00	5.708.997,92	28.462,50	0,50%	0,02%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.933.170,85	0,00	0,00	2.947.830,58	14.659,73	0,50%	0,69%	0,50%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	3.565.091,49	0,00	0,00	3.582.587,66	17.496,17	0,49%	0,06%	0,49%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.513.764,88	0,00	0,00	2.526.035,29	12.270,41	0,49%	0,07%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.353.575,03	0,00	1.050.000,00	17.392.843,42	89.268,39	0,49%	0,68%	0,50%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.929.662,81	200.000,00	0,00	4.148.704,34	19.041,53	0,46%	0,69%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.107.465,91	0,00	0,00	5.128.955,07	21.489,16	0,42%	3,13%	0,42%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	25.983,92	1.222.946,49	139.586,00	1.110.053,50	709,09	0,06%	0,00%	0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.009.847,09	0,00	0,00	4.991.816,74	-18.030,35	-0,36%	3,95%	-0,36%
Total Renda Fixa					194.923,50	0,40%	1,10%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.229.488,48	0,00	1.050.000,00	17.392.843,42	213.354,94	1,17%	1,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.622.741,86	0,00	0,00	5.708.997,92	86.256,06	1,53%	1,53%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	3.532.932,10	0,00	0,00	3.582.587,66	49.655,56	1,41%	1,41%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.905.066,86	200.000,00	0,00	4.148.704,34	43.637,48	1,09%	1,10%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.489.739,55	0,00	0,00	2.526.035,29	36.295,74	1,46%	1,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.913.871,45	0,00	0,00	2.947.830,58	33.959,13	1,17%	1,17%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.637.403,74	254.374,77	0,00	1.912.188,06	20.409,55	1,17%	1,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	692.508,09	2.082.572,76	1.672.479,59	1.110.053,50	7.452,24	0,73%	1,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.650.884,61	519.960,17	0,00	5.128.955,07	-41.889,71	-0,77%	-0,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.660.836,79	519.960,17	0,00	4.991.816,74	-188.980,22	-3,66%	-3,68%
Total Renda Fixa					260.150,77	0,53%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.964.612,39	0,00	1.100.000,00	17.392.843,42	528.231,03	2,94%	2,95%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.534.923,56	0,00	0,00	5.708.997,92	174.074,36	3,15%	3,15%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.840.259,28	200.000,00	0,00	4.148.704,34	108.445,06	2,80%	2,80%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	3.479.876,41	0,00	0,00	3.582.587,66	102.711,25	2,95%	2,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.627.023,73	1.399.308,36	0,00	5.128.955,07	102.622,98	2,63%	2,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.863.647,40	0,00	0,00	2.947.830,58	84.183,18	2,94%	2,94%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.451.915,51	0,00	0,00	2.526.035,29	74.119,78	3,02%	3,02%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.609.216,72	254.374,77	0,00	1.912.188,06	48.596,57	2,94%	2,94%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.075.098,95	3.279.569,04	3.262.915,51	1.110.053,50	18.301,02	1,72%	2,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.556.817,48	1.431.510,17	0,00	4.991.816,74	3.489,09	0,95%	1,03%
Total Renda Fixa					1.244.774,32	2,65%	

