

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2018



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

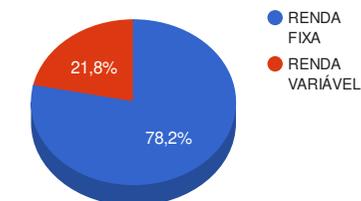
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.333.228,45	1,32%			Artigo 20
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.698.181,56	2,67%	1.257	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.851.886,77	14,69%	729	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	31.559.780,04	31,21%	1.448	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.954.711,03	7,87%	294	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.096.074,22	5,04%	783	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.354.483,90	8,26%	442	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.114.835,31	5,06%	82	3,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.430.388,22	2,40%	34	1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.996.698,49	3,95%	41	5,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.076.356,67	1,06%	77	0,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.094.224,43	2,07%	4.022	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+2	1280 dias	2.598.407,25	2,57%	13	9,72%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.101.491,62	2,08%	71	1,52%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.260.601,53	3,22%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.098.492,56	2,07%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	4.516.126,00	4,47%		2,64%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			101.135.968,05				

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

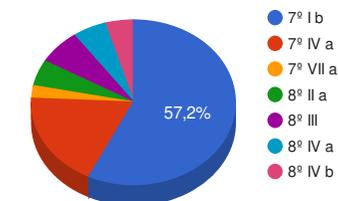
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	57.064.559,40	56,42%	15,00%	25,00%	70,00%	13.730.618,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	60.681.580,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	18.565.393,43	18,36%	5,00%	10,00%	30,00%	11.775.396,99
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	15.170.395,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.430.388,22	2,40%	2,00%	5,00%	5,00%	2.626.410,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.056.798,40
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.056.798,40
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.056.798,40
Total Renda Fixa	100,00%	78.060.341,05	77,18%	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%	10.113.596,81
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	5.073.055,16	5,02%	2,00%	5,00%	10,00%	5.040.541,65
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.794.123,30	6,72%	7,00%	10,00%	10,00%	3.319.473,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.359.094,09	5,30%	2,00%	5,00%	5,00%	-302.295,69
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.516.126,00	4,47%	2,00%	5,00%	5,00%	540.672,40
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.056.798,40
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.056.798,40
Total Renda Variável	30,00%	21.742.398,55	21,50%	19,00	40,00	50,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	57.064.559,40	56,42%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	18.565.393,43	18,36%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.430.388,22	2,40%	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	78.060.341,05	77,18%	40,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 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 "	5.073.055,16	5,02%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.794.123,30	6,72%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.359.094,09	5,30%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.516.126,00	4,47%	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	21.742.398,55	21,50%	19,00	50,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	42.008.488,37	41,54%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.642.841,04	26,34%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	7.954.711,03	7,87%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	7.216.326,93	7,14%	1,26%
ZION Invest	4.516.126,00	4,47%	0,92%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.260.601,53	3,22%	-
Horus GGR	2.598.407,25	2,57%	2,13%
Horus GGR	2.430.388,22	2,40%	1,99%
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	2.098.492,56	2,07%	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.076.356,67	1,06%	0,00%

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

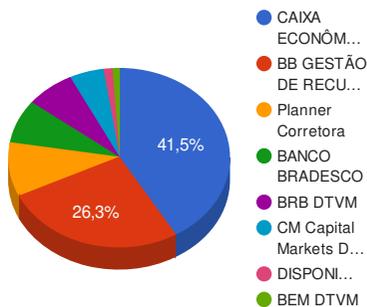
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	4,62%	0,73%	3,82%	8,98%	24,99%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	4,44%	0,67%	3,44%	8,41%	23,17%	0,20%	0,728%	2,05%
IPCA + 7,00% ao ano	0,92%	7,06%	3,77%	6,12%	11,74%	22,77%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3,99%	-18,61%	-1,72%	-17,08%	-17,81%	-11,60%	1,65%	3,913%	13,97%
IRF-M 1	0,66%	3,76%	1,41%	3,15%	7,39%	21,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	3,66%	1,38%	3,07%	7,21%	21,45%	0,20%	0,201%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	3,64%	1,36%	3,03%	7,15%	21,29%	0,10%	0,201%	0,50%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,66%	3,62%	1,33%	3,03%	7,14%	21,37%	0,20%	0,213%	0,50%
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,64%	4,27%	1,77%	3,43%	7,86%	23,16%	0,75%	0,221%	1,23%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	3,58%	1,51%	3,00%	6,93%	20,21%	0,20%	0,023%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	3,68%	1,54%	3,09%	7,11%	20,69%	0,20%	0,015%	0,08%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

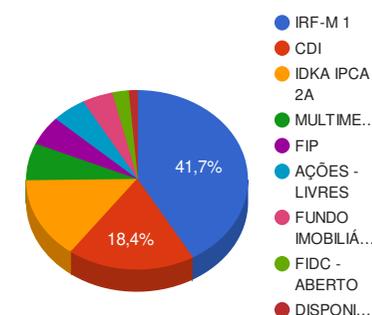
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	8,88%	3,69%	-8,01%	-6,70%	20,18%	38,24%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	9,28%	5,88%	-6,10%	-3,72%	22,49%	31,09%	1,00%	6,609%	18,30%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	9,16%	8,58%	-5,54%	-2,57%	21,42%	38,47%	2,00%	8,079%	18,61%
IPCA + 8,00% ao ano	1,01%	7,64%	4,01%	6,61%	12,77%	25,06%	-	-	-
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,30%	6,10%	1,65%	3,95%	-	-	1,50%	1,096%	5,92%
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,20%	-	-
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,71%	3,21%	-1,42%	-0,09%	10,36%	23,57%	1,00%	2,188%	5,32%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,58%	4,12%	1,76%	3,45%	7,82%	22,64%	1,00%	0,128%	0,71%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-18,37%	-9,09%	-10,31%	-11,11%	8,11%	35,14%	1,60%	67,104%	94,06%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	42.008.488,37	41,54%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.642.841,04	26,34%
Planner Corretora	9.875.220,09	9,76%
BANCO BRADESCO	7.954.711,03	7,87%
BRB DTVM	7.216.326,93	7,14%
CM Capital Markets DTVM	5.028.795,47	4,97%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.333.228,45	1,32%
BEM DTVM	1.076.356,67	1,06%

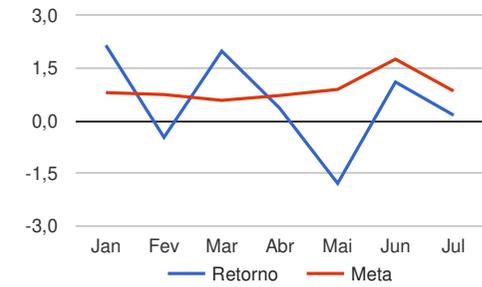
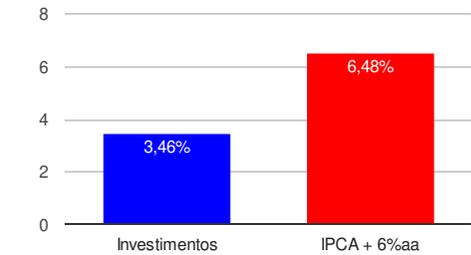


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	42.212.672,63	41,74%
CDI	18.565.393,43	18,36%
IDKA IPCA 2A	14.851.886,77	14,69%
MULTIMERCADO	6.794.123,30	6,72%
FIP	5.359.094,09	5,30%
AÇÕES - LIVRES	5.073.055,16	5,02%
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.516.126,00	4,47%
FIDC - ABERTO	2.430.388,22	2,40%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.333.228,45	1,32%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.337.029,46	0,00	0,00	2.430.388,22	93.358,76	3,99%	3,91%	3,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.670.898,84	0,00	0,00	14.851.886,77	180.987,93	1,23%	0,73%	1,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.376.852,68	137.898,57	170.000,00	31.559.780,04	215.028,79	0,68%	0,20%	0,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.680.074,83	0,00	0,00	2.698.181,56	18.106,73	0,68%	0,20%	0,68%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.902.862,20	0,00	0,00	7.954.711,03	51.848,83	0,66%	0,21%	0,66%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.082.069,26	0,00	0,00	5.114.835,31	32.766,05	0,64%	0,22%	0,64%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.309.281,79	0,00	0,00	8.354.483,90	45.202,11	0,54%	0,02%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.069.677,23	0,00	0,00	5.096.074,22	26.396,99	0,52%	0,02%	0,52%
Total Renda Fixa					663.696,19	0,86%	0,39%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.657.403,83	0,00	0,00	3.996.698,49	339.294,66	9,28%	6,61%	9,28%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	986.018,95	0,00	0,00	1.076.356,67	90.337,72	9,16%	8,08%	9,16%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.038.903,64	0,00	0,00	2.094.224,43	55.320,79	2,71%	2,19%	2,71%
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.580.530,04	0,00	0,00	2.598.407,25	17.877,21	0,69%	1,10%	0,30%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.089.308,72	0,00	0,00	2.101.491,62	12.182,90	0,58%	0,13%	0,58%
LA SHOPPING CENTERS MULTIELSTRATÉGIA FIP	2.102.131,97	0,00	0,00	2.098.492,56	-3.639,41	-0,17%	-	-
W7 MULTIELSTRATÉGIA FIP	3.266.382,13	0,00	0,00	3.260.601,53	-5.780,60	-0,18%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	5.532.254,35	0,00	0,00	4.516.126,00	-1.016.128,35	-18,37%	67,10%	-18,37%
Total Renda Variável					-510.535,08	-2,29%	21,11%	

