

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

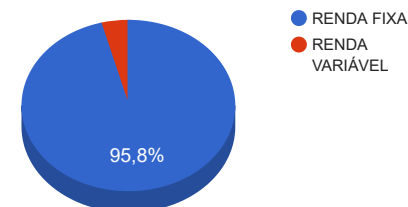
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			14.118,83	0,24%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			465.400,98	7,76%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.296.532,13	21,62%	27	0,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.097.409,38	18,30%	298	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.329.404,52	22,17%	741	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.943,99	0,13%	623	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	816.748,59	13,62%	300	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	502.164,44	8,37%	809	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	194.799,75	3,25%	331	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	22.930,29	0,38%		0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	249.999,75	4,17%		0,12%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	5.997.452,65				

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

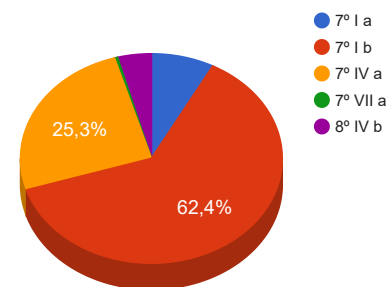
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	465.400,98	7,76%	0,00%	0,00%	15,00%	434.216,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	3.731.290,02	62,21%	20,00%	30,00%	70,00%	466.926,84
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	3.598.471,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	1.513.712,78	25,24%	5,00%	10,00%	30,00%	285.523,02
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	899.617,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	22.930,29	0,38%	0,00%	0,00%	2,00%	97.018,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	299.872,63
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	599.745,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	599.745,27
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	599.745,27
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	299.872,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	249.999,75	4,17%	0,00%	5,00%	5,00%	49.872,88
Total Carteira		5.983.333,82					

RENDA FIXA	5.747.452,90	96,06%
RENDA VARIÁVEL	249.999,75	4,18%

Distribuição por Segmento



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 " a "	465.400,98	7,76%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	3.731.290,02	62,21%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.513.712,78	25,24%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	22.930,29	0,38%	0,00%	2,00%
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%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
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%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	249.999,75	4,17%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	5.983.333,82	99,76%	39,00	242,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.329.404,52	22,17%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.326.857,02	22,12%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	1.296.532,13	21,62%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.292.209,13	21,55%	0,00%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	465.400,98	7,76%	-
ZION Invest	249.999,75	4,17%	0,05%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	22.930,29	0,38%	0,00%

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

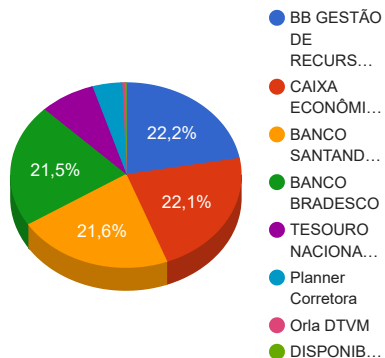
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,56%	4,19%	1,59%	3,15%	6,68%	19,56%	0,20%	0,006%	0,05%
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,55%	4,18%	1,59%	3,13%	6,66%	19,41%	0,15%	0,000%	0,04%
IPCA + 7,00% ao ano	0,53%	7,62%	3,32%	5,83%	11,43%	22,12%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.800,00%	1.104,66%	1.303,64%	651,72%	-3,20%	-62,99%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,44%	4,21%	1,65%	3,04%	6,90%	20,96%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,38%	3,88%	1,52%	2,79%	6,41%	20,03%	0,40%	0,244%	0,52%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38%	4,01%	1,55%	2,88%	6,61%	20,42%	0,20%	0,244%	0,52%
IDKA IPCA 2 Anos	0,10%	4,72%	1,86%	3,28%	8,04%	23,52%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,08%	4,36%	1,45%	2,79%	7,27%	21,51%	0,20%	1,427%	2,22%
IMA-B	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,46%	2,87%	1,46%	-1,02%	4,31%	20,36%	0,20%	3,476%	4,83%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

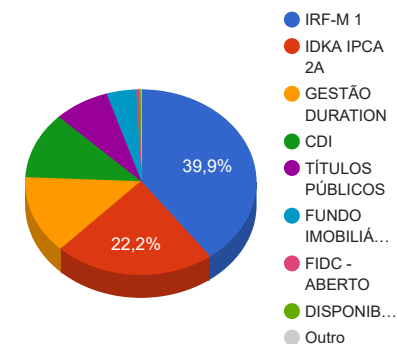
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-5,50%	-14,09%	-3,08%	-7,80%	5,00%	30,34%	1,60%	32,092%	95,25%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.329.404,52	22,17%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.326.857,02	22,12%
BANCO SANTANDER	1.296.532,13	21,62%
BANCO BRADESCO	1.292.209,13	21,55%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	465.400,98	7,76%
Planner Corretora	249.999,75	4,17%
Orla DTVM	22.930,29	0,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	14.118,83	0,24%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.393.941,51	39,92%
IDKA IPCA 2A	1.329.404,52	22,17%
GESTÃO DURATION	816.748,59	13,62%
CDI	696.964,19	11,62%
TÍTULOS PÚBLICOS	465.400,98	7,76%
FUNDO IMOBILIÁRIO	249.999,75	4,17%
FIDC - ABERTO	22.930,29	0,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	14.118,83	0,24%
IMA-B	7.943,99	0,13%

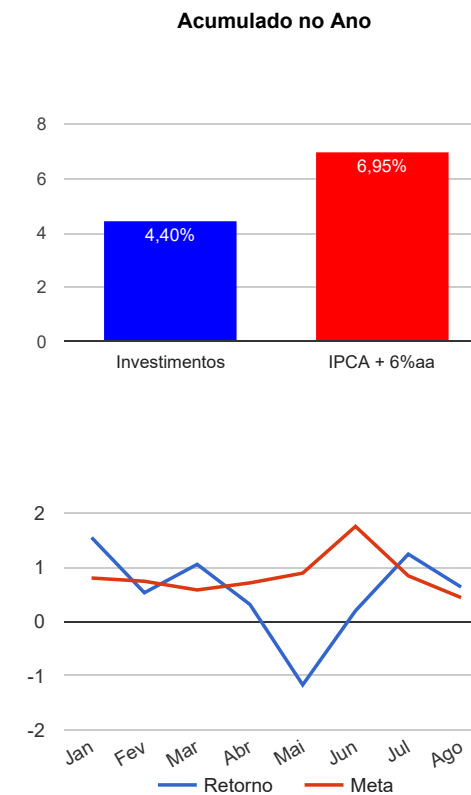


Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/06/2005	145	1385,63660000	3.209,661912	200.917,31	465.400,98	264.483,67

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	5.153.470,33	278.000,00	117.520,94	5.396.042,74	82.093,35	1,54%	0,80%	192,75%	0,65%
Fevereiro	5.396.042,74	21.090,51	96.981,64	5.348.677,16	28.525,55	0,53%	0,74%	71,59%	0,75%
Março	5.348.677,16	163.500,00	126.677,33	5.442.134,73	56.634,90	1,05%	0,58%	182,20%	0,72%
Abril	5.442.134,73	119.000,00	119.044,56	5.459.137,89	17.047,72	0,31%	0,71%	44,26%	0,48%
Maio	5.459.137,89	295.000,00	122.703,85	5.565.730,52	-65.703,52	-1,17%	0,89%	-131,28%	1,06%
Junho	5.565.730,52	0,00	217.695,11	5.358.992,45	10.957,04	0,20%	1,75%	11,23%	2,07%
Julho	5.358.992,45	588.450,77	120.382,06	5.899.280,89	72.219,73	1,24%	0,84%	147,25%	3,82%
Agosto	5.899.280,89	1.540.525,58	1.494.139,43	5.983.333,82	37.666,78	0,63%	0,44%	143,08%	2,05%
Acumulado no ano					239.441,55	4,40%	6,95%	63,32%	



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(%)
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.547,74	0,00	0,00	22.930,29	21.382,55	1.381,53%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.316.778,57	0,00	1.316.778,57	7.943,99	7.943,99	0,60%	3,48%	-0,46%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	191.474,28	2.259,34	0,00	194.799,75	1.066,13	0,55%	0,00%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	500.000,00	0,00	502.164,44	2.164,44	0,43%	0,01%	0,56%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.389.762,45	45.493,10	144.000,00	1.296.532,13	5.276,58	0,37%	0,24%	0,38%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	937.661,66	175.994,57	19.924,18	1.097.409,38	3.677,33	0,33%	0,24%	0,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	816.778,57	0,00	816.748,59	-29,98	0,00%	0,89%	0,14%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.330.426,47	0,00	0,00	1.329.404,52	-1.021,95	-0,08%	1,43%	-0,08%
TÍTULOS PÚBLICOS	481.629,97	0,00	13.436,68	465.400,98	-2.792,31	-0,58%	-	-
Total Renda Fixa					37.666,78	0,66%	0,62%	

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(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	249.999,75	0,00	0,00	249.999,75	0,00	0,00%	32,09%	-5,50%
Total Renda Variável					0,00	0,00%	32,09%	