

# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

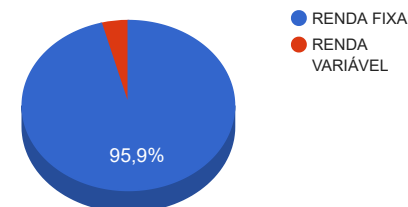
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			12.149,11	0,20%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			464.208,89	7,65%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.352.990,87	22,30%	28	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.091.025,56	17,98%	298	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.344.975,22	22,16%	733	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.929,65	0,13%	599	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	822.108,89	13,55%	310	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	504.396,63	8,31%	822	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	195.690,81	3,22%	344	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	22.852,72	0,38%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	249.999,75	4,12%		0,12%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>6.068.328,10</b>				

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

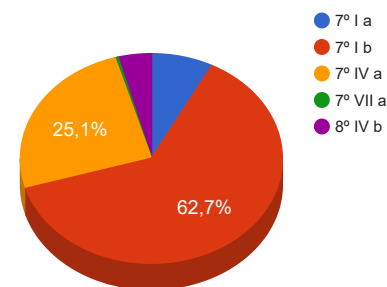
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	464.208,89	7,65%	0,00%	0,00%	15,00%	446.040,33
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	3.796.921,30	62,57%	20,00%	30,00%	70,00%	450.908,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	3.640.996,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	1.522.196,33	25,08%	5,00%	10,00%	30,00%	298.302,10
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	910.249,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	22.852,72	0,38%	0,00%	0,00%	2,00%	98.513,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	303.416,41
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	606.832,81
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	606.832,81
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	606.832,81
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	303.416,41
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	249.999,75	4,12%	0,00%	5,00%	5,00%	53.416,66
<b>Total Carteira</b>		<b>6.056.178,99</b>					

RENDA FIXA	5.818.328,35	96,07%
RENDA VARIÁVEL	249.999,75	4,13%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	464.208,89	7,65%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	3.796.921,30	62,57%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.522.196,33	25,08%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	22.852,72	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	4,12%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.056.178,99</b>	<b>99,80%</b>	<b>39,00</b>	<b>242,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	1.352.990,87	22,30%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.344.975,22	22,16%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.334.435,17	21,99%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.286.716,37	21,20%	0,00%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	464.208,89	7,65%	-
ZION Invest	249.999,75	4,12%	0,05%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	22.852,72	0,38%	0,00%

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

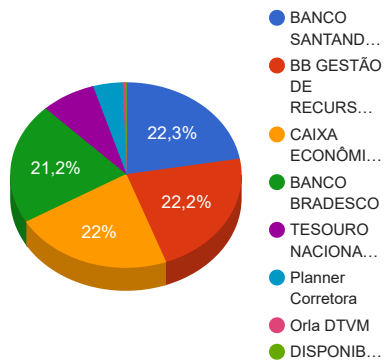
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,58%	2,34%	2,47%	7,60%	21,30%	0,20%	0,881%	2,27%
IPCA + 7,00% ao ano	0,99%	8,69%	2,47%	6,18%	11,75%	22,54%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,00%	1.104,66%	-	1.170,91%	-5,55%	-60,62%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	4,65%	1,66%	2,85%	6,51%	19,76%	0,20%	0,160%	0,53%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,57%	4,48%	1,63%	2,74%	6,28%	19,37%	0,40%	0,158%	0,52%
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,75%	1,35%	5,79%	-	0,002	0,548%	1,69%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BRANCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,46%	4,66%	1,55%	3,07%	6,48%	18,67%	0,15%	0,001%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	4,65%	1,53%	3,08%	6,48%	18,78%	0,20%	0,020%	0,04%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	2,69%	1,64%	-2,10%	2,28%	18,27%	0,20%	1,890%	4,88%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

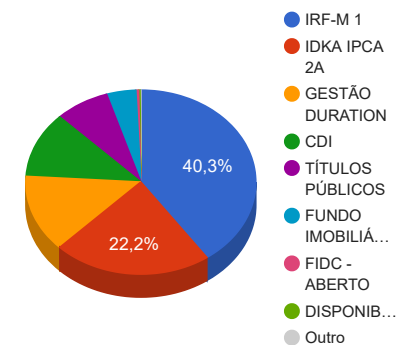
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	0,00%	-14,09%	-22,86%	-19,57%	5,00%	30,34%	1,60%	27,700%	95,99%

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

Administrador	Valor	%
BANCO SANTANDER	1.352.990,87	22,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.344.975,22	22,16%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.334.435,17	21,99%
BANCO BRADESCO	1.286.716,37	21,20%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	464.208,89	7,65%
Planner Corretora	249.999,75	4,12%
Orla DTVM	22.852,72	0,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	12.149,11	0,20%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.444.016,43	40,27%
IDKA IPCA 2A	1.344.975,22	22,16%
GESTÃO DURATION	822.108,89	13,55%
CDI	700.087,44	11,54%
TÍTULOS PÚBLICOS	464.208,89	7,65%
FUNDO IMOBILIÁRIO	249.999,75	4,12%
FIDC - ABERTO	22.852,72	0,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	12.149,11	0,20%
IMA-B	7.929,65	0,13%





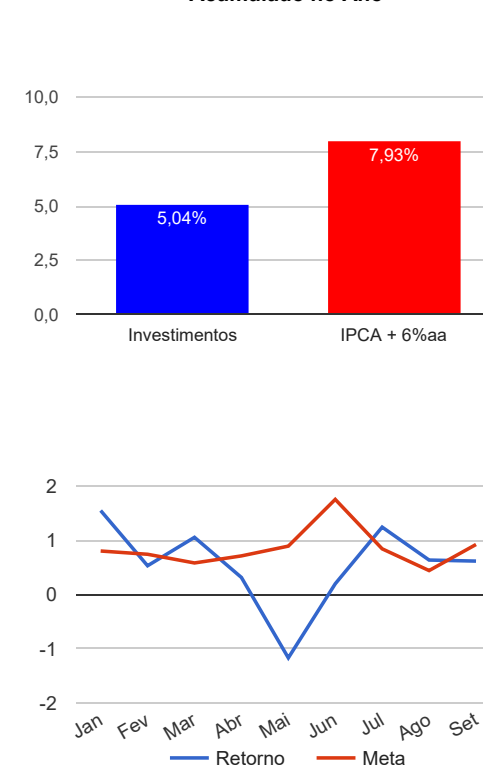
Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 2018)

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	3.201,440601	200.917,31	464.208,89	263.291,58

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%
Mai	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%
Setembro	5.983.333,82	157.000,00	121.134,30	6.056.178,99	36.979,47	0,61%	0,92%	66,60%	1,61%
Acumulado no ano					276.421,02	5,04%	7,93%	63,53%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.329.404,52	0,00	0,00	1.344.975,22	15.570,70	1,17%	0,88%	1,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	816.748,59	0,00	0,00	822.108,89	5.360,30	0,66%	0,55%	0,66%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.097.409,38	0,00	13.134,30	1.091.025,56	6.750,48	0,62%	0,16%	0,62%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.296.532,13	157.000,00	108.000,00	1.352.990,87	7.458,74	0,51%	0,16%	0,57%
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	194.799,75	0,00	0,00	195.690,81	891,06	0,46%	0,00%	0,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	502.164,44	0,00	0,00	504.396,63	2.232,19	0,44%	0,02%	0,44%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.943,99	0,00	0,00	7.929,65	-14,34	-0,18%	1,89%	-0,18%
TÍTULOS PÚBLICOS	465.400,98	0,00	0,00	464.208,89	-1.192,09	-0,26%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	22.930,29	0,00	0,00	22.852,72	-77,57	-0,34%	-	-
Total Renda Fixa					36.979,47	0,64%	0,39%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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%	27,70%	0,00%
Total Renda Variável					0,00	0,00%	27,70%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.287.145,59	0,00	1.316.778,57	7.929,65	37.562,63	2,73%	1,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.314.213,64	0,00	0,00	1.344.975,22	30.761,58	2,34%	2,34%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.339.033,64	350.146,84	357.833,50	1.352.990,87	21.643,89	1,49%	1,63%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.536,19	0,00	0,00	22.852,72	21.316,53	1.387,62%	-
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	946.003,71	175.994,57	47.607,04	1.091.025,56	16.634,32	1,61%	1,66%
TÍTULOS PÚBLICOS	471.059,68	0,00	13.436,68	464.208,89	6.585,89	1,39%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	816.778,57	0,00	822.108,89	5.330,32	0,65%	1,75%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	500.000,00	0,00	504.396,63	4.396,63	0,88%	1,53%
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,00	193.056,62	0,00	195.690,81	2.634,19	1,37%	1,55%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>146.865,98</b>	<b>2,62%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	0,00	249.999,75	0,00	249.999,75	0,00	0,00%	-22,86%
Total Renda Variável					0,00	0,00%	