

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018



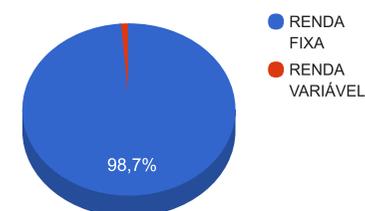
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	620.532,19	1,21%	720	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.027.012,72	3,94%	199	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	726.179,38	1,41%	355	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.283.598,18	8,33%	625	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	985.395,46	1,92%	590	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.798.173,19	17,10%	707	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.749.513,92	17,01%	158	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	516.791,18	1,00%	228	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.040.315,34	2,02%	122	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.378,27	0,01%	234	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	641.880,56	1,25%	236	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.693.827,88	11,07%	79	1,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.342.369,06	8,44%	756	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	898.477,33	1,75%	101	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.454.542,19	2,83%	648	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.620.189,49	16,76%	736	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.365.582,64	2,65%	98	1,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	427.184,06	0,83%	67	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	246.210,50	0,48%	923	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
TOTAL -			51.441.153,54				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	27.747.511,56	53,94%	15,00%	25,00%	70,00%	8.261.295,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	30.864.692,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	21.654.664,78	42,10%	5,00%	10,00%	30,00%	-6.222.318,72
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	7.716.173,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.365.582,64	2,65%	2,00%	5,00%	5,00%	1.206.475,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.572.057,68
Total Renda Fixa	100,00%	50.767.758,98	98,69%	36,00	70,00	190,00	-

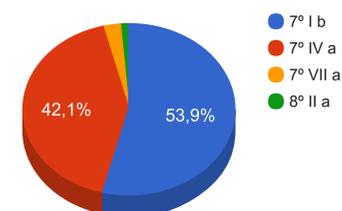
Distribuição por Segmento



 O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

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%	5.144.115,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	673.394,56	1,31%	2,00%	5,00%	10,00%	4.470.720,79
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	5.144.115,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.572.057,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.572.057,68
Total Renda Variável	30,00%	673.394,56	1,31%	15,00	30,00	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	27.747.511,56	53,94%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	21.654.664,78	42,10%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.365.582,64	2,65%	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%
Total Renda Fixa	50.767.758,98	98,69%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 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 "	673.394,56	1,31%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	673.394,56	1,31%	15,00	40,00

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

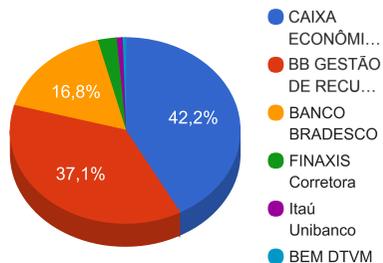
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.705.339,13	42,19%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.077.519,28	37,09%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	8.865.528,43	17,23%	0,00%
FINAXIS CORRETORA	1.365.582,64	2,65%	1,33%
ITAÚ UNIBANCO	427.184,06	0,83%	0,00%

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

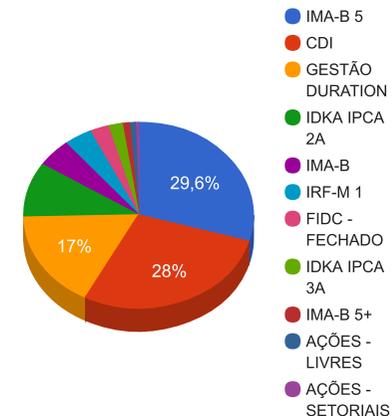
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (janeiro / 2018) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.705.339,13	42,19%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.077.519,28	37,09%
BANCO BRADESCO	8.619.317,93	16,76%
FINAXIS Corretora	1.365.582,64	2,65%
Itaú Unibanco	427.184,06	0,83%
BEM DTVM	246.210,50	0,48%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	15.218.180,45	29,58%
CDI	14.420.479,01	28,03%
GESTÃO DURATION	8.749.513,92	17,01%
IDKA IPCA 2A	4.904.130,37	9,53%
IMA-B	2.525.753,35	4,91%
IRF-M 1	2.027.012,72	3,94%
FIDC - FECHADO	1.365.582,64	2,65%
IDKA IPCA 3A	1.040.315,34	2,02%
IMA-B 5+	516.791,18	1,00%
AÇÕES - LIVRES	427.184,06	0,83%
AÇÕES - SETORIAIS	246.210,50	0,48%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Microsoft VBScript runtime error '800a0006'

Overflow

/plataforma/relatorios/uAcumulado.asp, line 151

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	Dados atualizados da meta referente ao mês ainda não disponíveis.								