

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2018



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

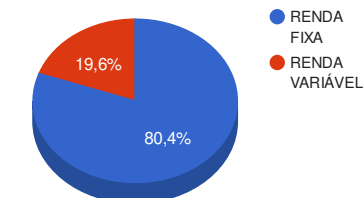
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			151.790,41	0,15%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.359.917,64	1,38%	1.411	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.753.386,12	14,96%	740	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.749.640,10	4,82%	372	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.586.088,47	4,65%	208	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.176.937,19	15,39%	760	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.412.760,78	15,63%	742	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.377.585,98	2,41%	84	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.230.503,91	8,35%	434	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.019.919,39	5,09%	719	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.025.857,54	5,10%	72	4,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.472.936,79	2,51%	37	0,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.139.435,79	1,16%	75	0,86%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.000.000,00	1,01%	35	1,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.065.180,77	2,09%	62	1,99%	Artigo 8º, Inciso III
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+2	1280 dias	2.546.170,36	2,58%	13	9,68%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.124.447,85	2,15%	4.411	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.108.672,94	2,14%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.277.697,55	3,32%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	5.035.480,49	5,11%		2,64%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			98.614.410,07				

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

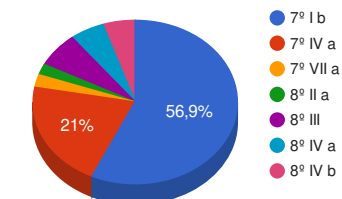
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	56.038.730,30	56,83%	15,00%	25,00%	70,00%	12.991.356,75
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	59.168.646,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	20.653.866,82	20,94%	5,00%	10,00%	30,00%	8.930.456,20
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	14.792.161,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.472.936,79	2,51%	2,00%	5,00%	5,00%	2.457.783,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.930.720,50
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.930.720,50
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.930.720,50
Total Renda Fixa	100,00%	79.165.533,91	80,28%	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%	9.861.441,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.139.435,79	2,17%	2,00%	5,00%	10,00%	7.722.005,22
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.735.798,98	6,83%	7,00%	10,00%	10,00%	3.125.642,03
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.386.370,49	5,46%	2,00%	5,00%	5,00%	-455.649,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	5.035.480,49	5,11%	2,00%	5,00%	5,00%	-104.759,99
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.930.720,50
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.930.720,50
Total Renda Variável	30,00%	19.297.085,75	19,57%	19,00	40,00	50,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	56.038.730,30	56,83%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	20.653.866,82	20,94%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.472.936,79	2,51%	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	79.165.533,91	80,28%	40,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 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 "	2.139.435,79	2,17%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.735.798,98	6,83%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.386.370,49	5,46%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5.035.480,49	5,11%	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	19.297.085,75	19,57%	19,00	50,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 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	42.304.567,37	42,90%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	25.522.945,61	25,88%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	7.091.038,31	7,19%	1,50%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.963.674,45	7,06%	0,00%
ZION Invest	5.035.480,49	5,11%	47,35%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.277.697,55	3,32%	-
Horus Investimentos	2.546.170,36	2,58%	1,19%
GGR INVESTIMENTOS	2.472.936,79	2,51%	0,60%
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	2.108.672,94	2,14%	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.139.435,79	1,16%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,82%	3,86%	3,07%	5,34%	12,30%	27,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	3,75%	2,76%	4,94%	11,42%	25,59%	0,20%	0,324%	2,70%
IPCA + 7,00% ao ano	0,79%	3,17%	2,27%	5,04%	9,90%	22,36%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-12,71%	-17,19%	-15,62%	-17,74%	-16,80%	-6,82%	0,15%	19,508%	-
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,55%	2,46%	1,63%	3,59%	8,90%	25,59%	0,75%	0,187%	8,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,11%	1,53%	3,28%	8,19%	22,87%	0,20%	0,018%	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	2,05%	1,47%	3,18%	7,97%	22,40%	0,20%	0,008%	0,14%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,26%	1,67%	3,45%	8,77%	23,56%	0,20%	0,069%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,25%	1,67%	3,44%	8,76%	23,60%	0,20%	0,067%	0,63%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	3,89%	2,55%	4,89%	11,44%	25,88%	0,20%	0,481%	3,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	3,89%	2,54%	4,88%	11,47%	25,92%	0,20%	0,481%	3,47%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,39%	3,98%	2,63%	4,97%	11,59%	26,20%	0,20%	0,517%	3,69%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,72%	1,30%	4,74%	10,70%	28,86%	0,20%	1,346%	8,97%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,88%	12,71%	1,42%	15,89%	31,67%	59,74%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,85%	12,76%	2,54%	13,82%	28,36%	50,87%	1,00%	7,917%	19,06%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1,23%	14,95%	3,14%	17,08%	30,26%	57,44%	2,00%	7,957%	17,45%

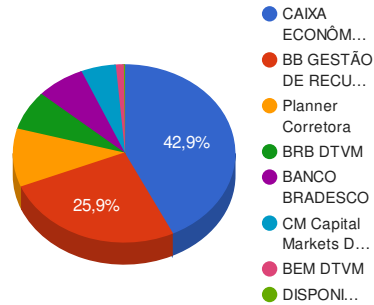
IPCA + 8,00% ao ano	0,86%	3,48%	2,49%	5,51%	10,92%	24,64%	-	-	-
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,48%	4,37%	2,26%	-	-	-	1,50%	2,086%	-
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,20%	-	-

CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,55%	2,32%	1,66%	3,47%	8,92%	29,44%	1,00%	0,074%	4,22%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,51%	4,70%	1,35%	6,22%	13,49%	30,57%	1,00%	2,298%	6,33%

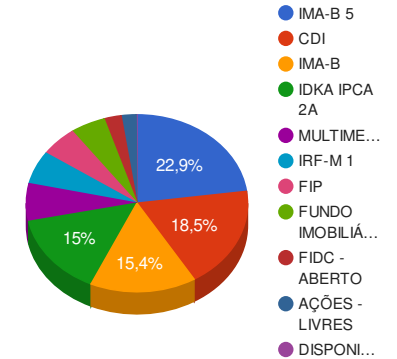
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-5,11%	1,36%	-0,89%	12,63%	48,67%	52,74%	1,60%	55,205%	72,75%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	42.304.567,37	42,90%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	25.522.945,61	25,88%
Planner Corretora	10.421.850,98	10,57%
BRB DTVM	7.091.038,31	7,19%
BANCO BRADESCO	6.963.674,45	7,06%
CM Capital Markets DTVM	5.019.107,15	5,09%
BEM DTVM	1.139.435,79	1,16%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	151.790,41	0,15%

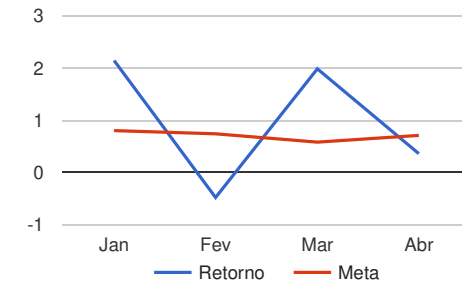
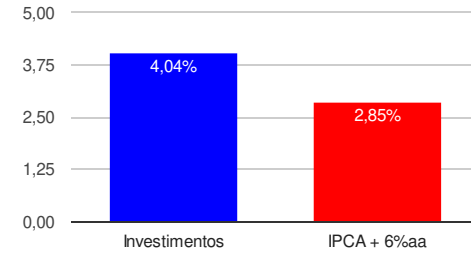


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	22.539.986,86	22,86%
CDI	18.276.280,84	18,53%
IMA-B	15.176.937,19	15,39%
IDKA IPCA 2A	14.753.386,12	14,96%
MULTIMERCADO	6.735.798,98	6,83%
IRF-M 1	5.946.006,11	6,03%
FIP	5.386.370,49	5,46%
FUNDO IMOBILIÁRIO	5.035.480,49	5,11%
FIDC - ABERTO	2.472.936,79	2,51%
AÇÕES - LIVRES	2.139.435,79	2,17%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	151.790,41	0,15%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	14.652.175,58	0,00	0,00	14.753.386,12	101.210,54	0,69%	0,32%	0,69%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.087.586,32	0,00	94.000,00	5.019.919,39	26.333,07	0,52%	0,02%	0,52%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.025.857,54	25.857,54	0,52%	0,19%	0,55%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.189.888,55	0,00	0,00	8.230.503,91	40.615,36	0,50%	0,01%	0,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.350.547,54	0,00	0,00	15.412.760,78	62.213,24	0,41%	0,48%	0,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.730.492,96	0,00	0,00	4.749.640,10	19.147,14	0,40%	0,48%	0,40%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.368.418,08	0,00	0,00	2.377.585,98	9.167,90	0,39%	0,52%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.534.935,26	742.860,81	926.087,76	1.359.917,64	8.209,33	0,36%	0,07%	0,49%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.568.261,28	0,00	4.006.000,00	4.586.088,47	23.827,19	0,28%	0,07%	0,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.201.319,81	0,00	0,00	15.176.937,19	-24.382,62	-0,16%	1,35%	-0,16%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.832.851,67	0,00	0,00	2.472.936,79	-359.914,88	-12,71%	19,51%	-12,71%
				Total Renda Fixa	-67.716,19	-0,09%	1,08%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	1.397.964,42	0,00	0,00	2.108.672,94	710.708,52	50,84%	-	-
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.125.629,14	0,00	0,00	1.139.435,79	13.806,65	1,23%	7,96%	1,23%
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.529.312,05	0,00	0,00	2.546.170,36	16.858,31	0,67%	2,09%	1,48%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.053.943,87	0,00	0,00	2.065.180,77	11.236,90	0,55%	0,07%	0,55%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.113.586,79	0,00	0,00	2.124.447,85	10.861,06	0,51%	2,30%	0,51%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00%	7,92%	1,85%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.284.016,85	0,00	0,00	3.277.697,55	-6.319,30	-0,19%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	5.374.189,94	0,00	0,00	5.035.480,49	-338.709,45	-6,30%	55,21%	-5,11%
Total Renda Variável					418.442,69	2,22%	21,95%	

