

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2018



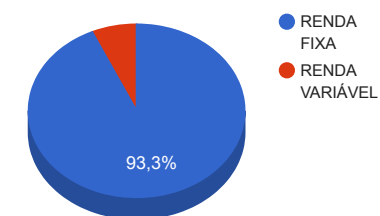
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.350.958,53	12,63%	372	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.078.165,50	19,43%	1.411	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.143.352,20	10,69%	654	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	39.546,52	0,37%	1.222	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	687.708,05	6,43%	740	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.558.385,52	14,57%	760	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.188.087,47	11,11%	203	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	78.508,95	0,73%	654	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	1.064.760,09	9,95%	405	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	552.235,10	5,16%	101	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	76.341,94	0,71%	257	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	158.279,23	1,48%	163	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	212.777,32	1,99%	873	0,29%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	508.402,29	4,75%	4.411	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
TOTAL -			10.697.508,71				

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

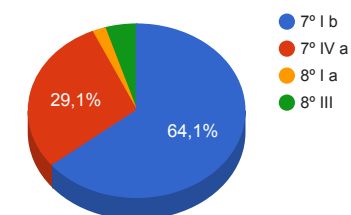
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	6.858.116,32	64,11%	20,00%	30,00%	70,00%	630.139,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	6.418.505,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	3.118.212,78	29,15%	5,00%	10,00%	30,00%	91.039,83
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	1.604.626,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	534.875,44
Total Renda Fixa	100,00%	9.976.329,10	93,26%	39,00	70,00	185,00	-

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%	212.777,32	1,99%	2,00%	5,00%	10,00%	856.973,55
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	1.069.750,87
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	508.402,29	4,75%	7,00%	10,00%	10,00%	561.348,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	534.875,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	534.875,44
Total Renda Variável	30,00%	721.179,61	6,74%	15,00	30,00	40,00	-

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 "	6.858.116,32	64,11%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.118.212,78	29,15%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
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	9.976.329,10	93,26%	39,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	212.777,32	1,99%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	508.402,29	4,75%	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	721.179,61	6,74%	15,00	40,00

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	8.169.730,11	76,37%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.156.722,05	20,16%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	371.056,55	3,47%	0,00%

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	3,87%	2,89%	5,02%	11,52%	25,80%	0,20%	0,320%	2,65%
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 + 6,00% ao ano	0,71%	2,85%	2,04%	4,56%	8,88%	20,09%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,50%	2,77%	1,91%	3,80%	9,76%	25,03%	0,30%	0,208%	2,08%
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,49%	2,02%	1,45%	3,11%	7,95%	22,12%	0,20%	0,004%	0,10%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,97%	1,39%	3,08%	7,85%	22,25%	0,20%	0,023%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	1,84%	1,32%	2,83%	7,23%	20,66%	0,80%	0,000%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,76%	1,26%	2,70%	6,96%	20,57%	1,00%	0,004%	0,09%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	2,24%	1,65%	3,42%	8,71%	23,41%	0,10%	0,068%	0,64%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-
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%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,33%	3,19%	2,17%	4,30%	9,68%	-	0,002	0,603%	4,10%

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
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%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '900000' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rv.asp, line 51