

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2019



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 / 2019)

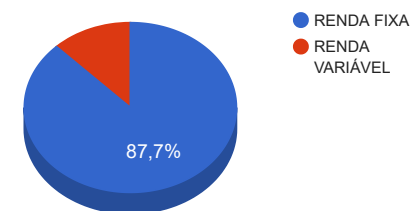
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.776.637,09	3,56%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.437.771,71	2,27%	805	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.348.107,33	2,01%	266	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.838.895,31	0,92%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	74.911.960,89	18,04%	1.449	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	79.731.683,61	19,20%	852	0,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	68.995.415,12	16,61%	811	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	5.486.162,03	1,32%	92	4,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.185.631,75	0,53%	1.248	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.189.772,20	0,53%	839	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	80.407.510,71	19,36%	454	1,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	4.087.290,72	0,98%	76	2,67%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	9.934.366,54	2,39%	73	1,84%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	16.493.362,51	3,97%	93	5,14%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.330.306,56	0,32%	150	0,29%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	18.641.398,89	4,49%	81	5,87%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	3.276.708,62	0,79%	955	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.011.964,99	0,73%	4.480	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	5.477.335,00	1,32%	729	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	2.699.244,35	0,65%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>415.261.525,93</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2019)

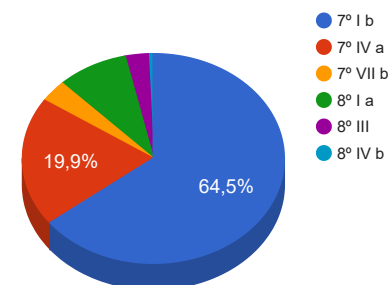
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	267.712.264,84	64,47%	15,00%	50,00%	90,00%	106.023.108,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	82.597.282,91	19,89%	5,00%	33,00%	40,00%	83.507.327,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	14.021.657,26	3,38%	1,00%	5,00%	5,00%	6.741.419,04
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	36.465.067,96	8,78%	2,00%	7,00%	10,00%	5.061.084,63
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	41.526.152,59
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.766.008,61	2,83%	1,00%	3,00%	10,00%	29.760.143,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.699.244,35	0,65%	0,00%	1,00%	5,00%	18.063.831,95
<b>Total Carteira</b>		<b>415.261.525,93</b>					

RENDA FIXA	364.331.205,01	87,74%
RENDA VARIÁVEL	50.930.320,92	12,26%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	267.712.264,84	64,47%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	82.597.282,91	19,89%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	14.021.657,26	3,38%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	36.465.067,96	8,78%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.766.008,61	2,83%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.699.244,35	0,65%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>415.261.525,93</b>	<b>100,00%</b>	<b>24,00</b>	<b>245,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 2019)

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	375.010.282,30	90,31%	0,08%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.551.999,28	9,04%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.699.244,35	0,65%	0,20%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,79%	9,59%	7,66%	13,41%	20,14%	29,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	9,44%	2,73%	13,07%	19,64%	31,89%	0,20%	2,399%	8,68%
IMA-B	1,51%	7,13%	5,54%	9,94%	15,59%	25,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	7,09%	2,59%	9,82%	15,40%	27,74%	0,20%	1,617%	5,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	3,61%	2,24%	4,99%	9,90%	21,52%	0,20%	0,539%	2,13%
IMA-B 5	1,11%	4,03%	2,90%	5,65%	9,94%	22,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	3,95%	2,38%	5,53%	9,73%	22,29%	0,20%	0,637%	3,08%
IPCA + 6,00% ao ano	1,06%	4,04%	2,95%	4,99%	11,19%	20,46%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	4,34%	2,49%	6,22%	19,07%	29,73%	0,20%	0,763%	4,71%
IDKA IPCA 2 Anos	1,03%	3,54%	2,48%	5,04%	9,41%	22,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	3,60%	2,30%	4,94%	9,02%	21,57%	0,20%	0,565%	2,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,95%	1,42%	2,91%	7,09%	15,89%	0,20%	0,000%	0,41%
IPCA	0,57%	2,09%	1,51%	2,04%	4,94%	7,38%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,14%	4,07%	2,58%	5,57%	10,75%	25,12%	0,20%	0,610%	3,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,12%	4,41%	2,46%	5,76%	9,78%	18,49%	0,20%	1,170%	2,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	5,11%	2,17%	6,91%	9,82%	20,46%	0,002	1,412%	3,41%
CDI	0,52%	2,04%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	2,00%	1,46%	2,99%	6,18%	14,69%	0,20%	0,002%	0,02%
IRF-M 1	0,50%	2,03%	1,53%	3,19%	6,68%	16,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	1,98%	1,40%	3,07%	6,52%	15,85%	0,20%	0,082%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,97%	1,38%	3,05%	6,47%	15,74%	0,10%	0,087%	0,55%

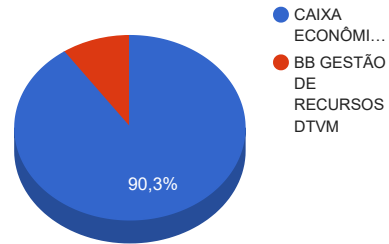
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	1,20%	9,61%	8,31%	12,07%	13,83%	43,40%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,98%	-1,30%	10,91%	15,31%	43,50%	1,00%	7,815%	21,89%
IFIX	1,03%	6,67%	5,58%	12,29%	7,32%	22,14%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
Ibovespa	0,98%	9,63%	8,56%	10,90%	11,89%	46,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,94%	9,40%	-1,10%	10,00%	11,36%	45,59%	0,50%	8,114%	22,48%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,48%	2,06%	1,06%	4,30%	-	-	1,60%	0,488%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,40%	1,57%	1,01%	3,03%	5,45%	-	1,60%	0,102%	2,23%
IBX-50	0,67%	9,11%	8,38%	9,82%	10,62%	46,05%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,25%	8,24%	-2,16%	7,72%	7,80%	43,49%	0,70%	8,077%	22,71%
CDI	0,52%	2,04%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,74%	4,05%	0,65%	4,90%	7,43%	21,92%	1,00%	2,242%	6,52%

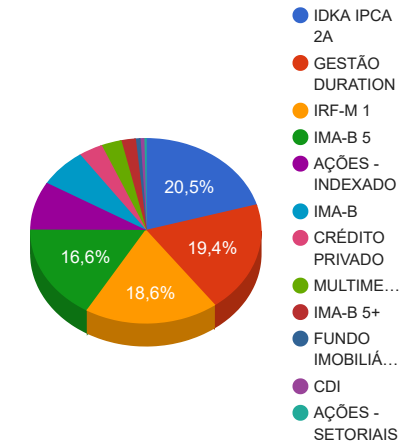


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	375.010.282,30	90,31%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	40.251.243,63	9,69%



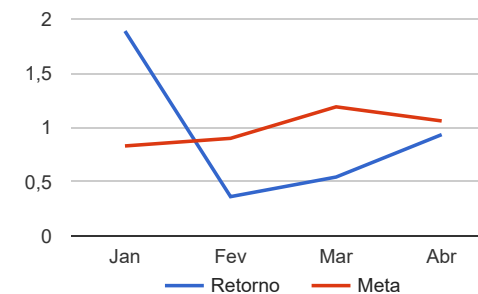
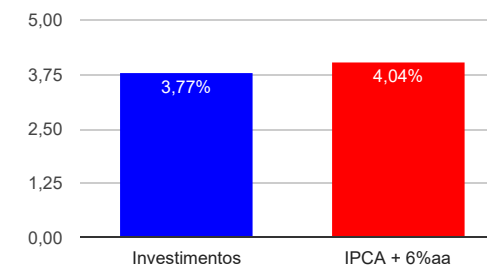
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	85.217.845,64	20,52%
GESTÃO DURATION	80.407.510,71	19,36%
IRF-M 1	77.097.592,64	18,57%
IMA-B 5	68.995.415,12	16,61%
AÇÕES - INDEXADO	35.134.761,40	8,46%
IMA-B	28.053.304,11	6,76%
CRÉDITO PRIVADO	14.021.657,26	3,38%
MULTIMERCADO	11.766.008,61	2,83%
IMA-B 5+	8.348.107,33	2,01%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.699.244,35	0,65%
CDI	2.189.772,20	0,53%
AÇÕES - SETORIAIS	1.330.306,56	0,32%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	389.532.929,62	58.367.638,88	53.792.246,74	401.544.963,80	7.436.642,04	1,89%	0,83%	226,90%	1,19%
Fevereiro	401.544.963,80	23.042.199,51	21.631.720,60	404.420.435,99	1.464.993,28	0,36%	0,90%	40,60%	1,66%
Março	404.420.435,99	4.412.933,34	3.043.627,51	407.996.984,75	2.207.242,93	0,54%	1,19%	45,57%	2,53%
Abril	407.996.984,75	8.549.454,06	5.129.100,00	415.261.525,93	3.844.187,12	0,93%	1,06%	88,19%	1,39%
Acumulado no ano					14.953.065,37	3,77%	4,04%	93,43%	

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.203.404,21	0,00	0,00	8.348.107,33	144.703,12	1,76%	2,40%	1,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.299.321,02	0,00	0,00	9.437.771,71	138.450,69	1,49%	1,62%	1,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.600.292,17	0,00	0,00	14.776.637,09	176.344,92	1,21%	0,76%	1,21%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	9.822.143,88	0,00	0,00	9.934.366,54	112.222,66	1,14%	0,61%	1,14%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.042.076,64	0,00	0,00	4.087.290,72	45.214,08	1,12%	1,17%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	79.525.156,73	0,00	0,00	80.407.510,71	882.353,98	1,11%	1,41%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.259.502,02	0,00	0,00	68.995.415,12	735.913,10	1,08%	0,64%	1,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	78.889.242,45	0,00	0,00	79.731.683,61	842.441,16	1,07%	0,56%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.799.203,15	0,00	0,00	3.838.895,31	39.692,16	1,04%	0,54%	1,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.178.734,76	0,00	0,00	2.189.772,20	11.037,44	0,51%	0,00%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.459.015,90	0,00	0,00	5.486.162,03	27.146,13	0,50%	0,00%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	76.950.082,29	2.690.405,88	5.112.000,00	74.911.960,89	383.472,72	0,48%	0,08%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.750.135,64	426.710,83	0,00	2.185.631,75	8.785,28	0,40%	0,09%	0,50%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.547.777,44</b>	<b>0,98%</b>	<b>0,74%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	13.642.257,91	4.793.403,56	0,00	18.641.398,89	205.737,42	1,12%	8,11%	0,94%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.989.986,49	0,00	0,00	3.011.964,99	21.978,50	0,74%	2,24%	0,74%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.320.929,79	0,00	0,00	1.330.306,56	9.376,77	0,71%	7,82%	0,71%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.261.179,13	0,00	0,00	3.276.708,62	15.529,49	0,48%	0,49%	0,48%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.455.395,00	0,00	0,00	5.477.335,00	21.940,00	0,40%	0,10%	0,40%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	15.807.015,19	638.933,79	0,00	16.493.362,51	47.413,53	0,29%	8,08%	0,25%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.741.910,38	0,00	17.100,00	2.699.244,35	-25.566,03	-0,93%	-	0,00%
Total Renda Variável					296.409,68	0,59%	6,30%	