

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

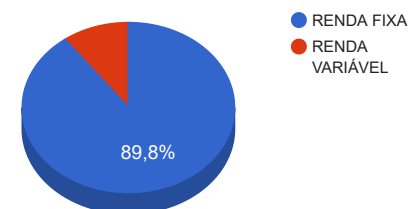
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.913,91	0,00%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.168.059,90	2,02%	241	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.774.463,97	0,93%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	76.610.025,14	18,94%	1.463	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	78.370.588,73	19,38%	799	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	67.741.648,34	16,75%	762	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	5.434.657,20	1,34%	95	4,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.338.268,63	0,33%	1.249	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.247.526,47	2,29%	751	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.489.652,75	3,58%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	3.009.217,90	0,74%	276	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	79.094.424,94	19,56%	387	1,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.168.620,99	0,54%	826	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	4.005.403,50	0,99%	76	2,59%	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	9.744.089,39	2,41%	74	1,77%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	12.366.192,88	3,06%	93	4,42%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.323.622,95	0,33%	142	0,29%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	13.136.065,40	3,25%	66	4,58%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.983.172,49	0,74%	4.356	0,42%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	5.437.780,00	1,34%	729	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	3.249.018,43	0,80%	955	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	2.727.935,99	0,67%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
			TOTAL -	404.426.349,90			

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

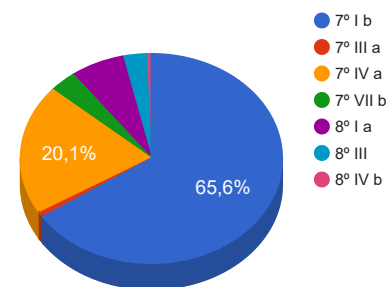
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	265.174.891,13	65,57%	15,00%	50,00%	90,00%	98.808.823,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	3.009.217,90	0,74%	0,00%	0,00%	60,00%	239.646.592,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	81.263.045,93	20,09%	5,00%	33,00%	40,00%	80.507.494,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	13.749.492,89	3,40%	1,00%	5,00%	5,00%	6.471.824,61
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	26.825.881,23	6,63%	2,00%	7,00%	10,00%	13.616.753,76
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	40.442.634,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.669.970,92	2,89%	1,00%	3,00%	10,00%	28.772.664,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.727.935,99	0,67%	0,00%	1,00%	5,00%	17.493.381,51
Total Carteira		404.420.435,99					

RENDA FIXA	363.202.561,76	89,81%
RENDA VARIÁVEL	41.223.788,14	10,19%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	265.174.891,13	65,57%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	3.009.217,90	0,74%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	81.263.045,93	20,09%	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 "	13.749.492,89	3,40%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	26.825.881,23	6,63%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.669.970,92	2,89%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.727.935,99	0,67%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	404.420.435,99	100,00%	24,00	245,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 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	365.587.745,11	90,40%	0,08%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.104.754,89	8,93%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.727.935,99	0,67%	0,17%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,90%	1,73%	2,36%	4,56%	10,12%	19,97%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	2,32%	3,88%	9,04%	18,38%	29,05%	0,20%	0,983%	4,59%
IMA-B 5+	0,55%	7,20%	9,21%	21,43%	17,23%	29,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	7,08%	9,01%	20,98%	16,72%	29,06%	0,20%	3,668%	7,98%
IMA-B	0,55%	4,94%	6,67%	15,14%	14,11%	26,50%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,55%	4,89%	6,60%	15,01%	14,00%	25,88%	0,20%	2,389%	5,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	1,87%	3,05%	6,95%	10,05%	22,09%	0,20%	0,631%	2,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	4,93%	6,64%	15,10%	13,92%	26,03%	0,20%	2,409%	5,55%
IMA-B 5	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	2,06%	3,47%	7,74%	9,90%	22,57%	0,20%	0,793%	3,06%
IDKA IPCA 2 Anos	0,53%	1,80%	3,07%	6,69%	10,19%	23,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	1,83%	3,01%	6,51%	9,63%	22,15%	0,20%	0,632%	2,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	0,99%	1,47%	2,94%	7,13%	17,24%	0,20%	0,000%	0,42%
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	1,01%	1,50%	2,99%	6,23%	15,70%	0,20%	0,005%	0,02%
IRF-M 1	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	1,02%	1,57%	3,66%	6,71%	17,04%	0,20%	0,083%	0,55%

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

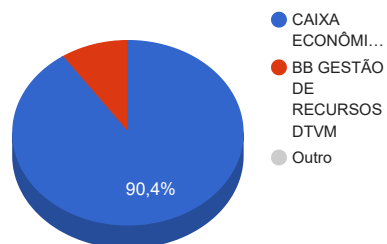
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,02%	1,56%	3,65%	6,65%	16,91%	0,10%	0,083%	0,55%
IPCA	0,43%	0,75%	0,90%	1,63%	3,89%	6,85%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,61%	2,08%	3,21%	7,48%	11,12%	25,60%	0,20%	0,669%	3,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,50%	3,40%	4,77%	7,64%	9,66%	20,69%	0,002	2,407%	2,44%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,41%	2,32%	3,52%	7,00%	8,69%	18,38%	0,20%	1,509%	2,47%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

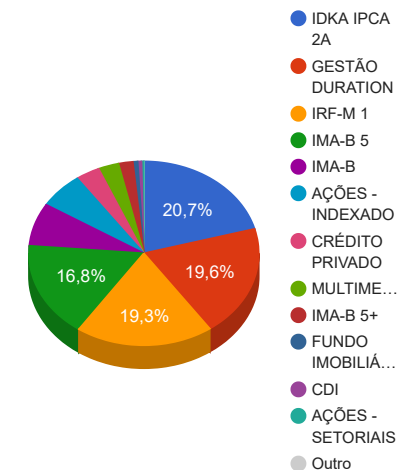
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,03%	3,53%	5,83%	13,80%	5,33%	20,00%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	0,000%	-
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,31%	3,06%	2,78%	8,61%	7,27%	21,99%	1,00%	2,852%	6,27%
Ibovespa	-1,86%	8,76%	6,79%	24,66%	11,99%	43,39%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,28%	0,84%	1,67%	5,12%	7,27%	-	1,60%	0,233%	2,43%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,21%	1,19%	2,60%	7,35%	-	-	1,60%	0,700%	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-1,83%	8,60%	6,70%	24,20%	11,44%	41,70%	0,50%	10,059%	21,56%
IBX-50	-1,69%	8,57%	6,29%	23,55%	10,83%	43,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-2,05%	8,36%	5,97%	21,82%	8,07%	40,94%	0,70%	10,013%	21,84%
IGC	-1,59%	8,25%	7,61%	25,52%	12,12%	41,65%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,80%	8,43%	7,49%	27,07%	14,37%	43,41%	1,00%	9,797%	20,82%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	365.587.745,11	90,40%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.832.690,88	9,60%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.913,91	0,00%



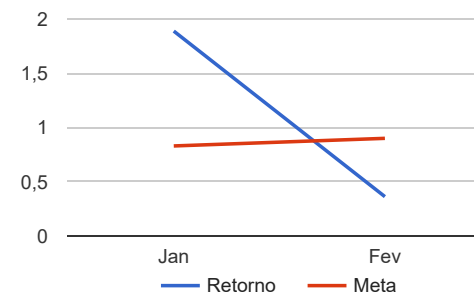
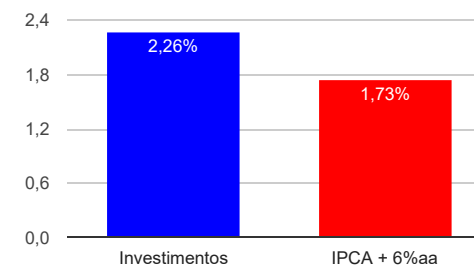
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	83.805.245,93	20,72%
GESTÃO DURATION	79.094.424,94	19,56%
IRF-M 1	77.948.293,77	19,27%
IMA-B 5	67.741.648,34	16,75%
IMA-B	30.520.861,09	7,55%
AÇÕES - INDEXADO	25.502.258,28	6,31%
CRÉDITO PRIVADO	13.749.492,89	3,40%
MULTIMERCADO	11.669.970,92	2,89%
IMA-B 5+	8.168.059,90	2,02%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.727.935,99	0,67%
CDI	2.168.620,99	0,54%
AÇÕES - SETORIAIS	1.323.622,95	0,33%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.913,91	0,00%



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%
Acumulado no ano					8.901.635,32	2,26%	1,73%	130,14%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	9.684.704,23	0,00	0,00	9.744.089,39	59.385,16	0,61%	0,67%	0,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	77.936.236,96	0,00	0,00	78.370.588,73	434.351,77	0,56%	0,63%	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	67.388.614,03	0,00	0,00	67.741.648,34	353.034,31	0,52%	0,79%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.859.601,70	0,00	105.033,25	3.774.463,97	19.895,52	0,52%	0,63%	0,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	78.699.890,69	0,00	0,00	79.094.424,94	394.534,25	0,50%	2,41%	0,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.127.562,61	3.000.000,00	0,00	8.168.059,90	40.497,29	0,50%	3,67%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.797.885,44	0,00	381.186,52	14.489.652,75	72.953,83	0,49%	0,98%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.409.106,79	0,00	0,00	5.434.657,20	25.550,41	0,47%	0,00%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	76.268.589,99	0,00	0,00	76.610.025,14	341.435,15	0,45%	0,08%	0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	795.771,02	8.413.265,95	0,00	9.247.526,47	38.489,50	0,42%	2,41%	0,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.199.117,83	0,00	21.120.000,83	2.168.620,99	89.503,99	0,39%	0,00%	0,48%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,00	3.000.000,00	0,00	3.009.217,90	9.217,90	0,31%	2,39%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	438.175,10	897.302,29	0,00	1.338.268,63	2.791,24	0,21%	0,08%	0,44%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	4.000.000,00	0,00	4.005.403,50	5.403,50	0,14%	1,51%	0,41%
Total Renda Fixa					1.887.043,82	0,52%	1,07%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.665.562,46	0,00	25.500,00	2.727.935,99	87.873,53	3,30%	0,00%	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.422.690,00	0,00	0,00	5.437.780,00	15.090,00	0,28%	0,23%	0,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.242.317,95	0,00	0,00	3.249.018,43	6.700,48	0,21%	0,70%	0,21%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.983.172,49	-16.827,51	-0,56%	2,85%	-0,31%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	12.635.803,31	731.631,27	0,00	13.136.065,40	-231.369,18	-1,73%	10,06%	-1,83%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.347.886,05	0,00	0,00	1.323.622,95	-24.263,10	-1,80%	9,80%	-1,80%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	12.625.447,64	0,00	0,00	12.366.192,88	-259.254,76	-2,05%	10,01%	-2,05%
Total Renda Variável					-422.050,54	-1,01%	6,82%	