

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

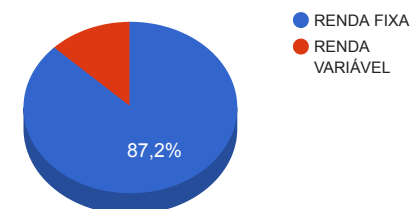
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			8.663,21	0,01%			Artigo 20
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	721.470,92	0,53%	119	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.727.548,44	2,72%	45	2,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	25.388.523,52	18,52%	1.454	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.226.645,90	3,81%	782	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.119.568,39	7,38%	830	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.227.034,25	0,89%	547	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.538.846,88	6,23%	442	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.897.346,12	18,16%	1.248	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.231.307,32	5,27%	819	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	438.008,77	0,32%	115	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	11.353.147,18	8,28%	775	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	15.171.853,34	11,06%	832	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.327.253,11	1,70%	705	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ILLUMINATI FIDC	D+1 ou D+1260	30 dias	3.217.763,04	2,35%	11	1,48%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	4.085.220,99	2,98%	955	0,87%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	3.725.599,42	2,72%	14	1,73%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.182.158,00	1,59%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	3.009.833,82	2,20%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	Não se aplica	Não se aplica	4.523.343,70	3,30%		12,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	137.121.136,32				

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

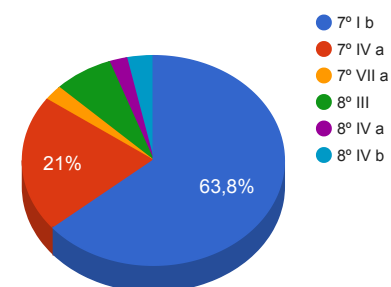
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	87.516.300,51	63,82%	15,00%	25,00%	70,00%	8.468.494,91
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	82.272.681,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.852.253,63	21,04%	10,00%	30,00%	40,00%	25.996.200,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.217.763,04	2,35%	2,00%	5,00%	5,00%	3.638.293,78
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	27.424.227,26
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.992.978,41	7,29%	7,00%	10,00%	10,00%	3.719.135,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.009.833,82	2,20%	2,00%	5,00%	5,00%	3.846.223,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.523.343,70	3,30%	2,00%	5,00%	5,00%	2.332.713,12
Total Carteira		137.112.473,11					

RENDA FIXA	119.594.980,39	87,22%
RENDA VARIÁVEL	17.526.155,93	12,78%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	87.516.300,51	63,82%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	28.852.253,63	21,04%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.217.763,04	2,35%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.992.978,41	7,29%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.009.833,82	2,20%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.523.343,70	3,30%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	137.112.473,11	99,99%	30,00	240,00

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

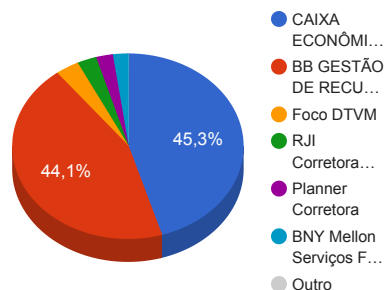
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	62.173.970,14	45,34%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.461.962,99	44,09%	0,00%
ROMA ASSET	4.523.343,70	3,30%	1,34%
RJI Gestão & Investimentos	3.725.599,42	2,72%	-
Queluz Gestão de Recursos	3.217.763,04	2,35%	-
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	3.009.833,82	2,20%	-

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

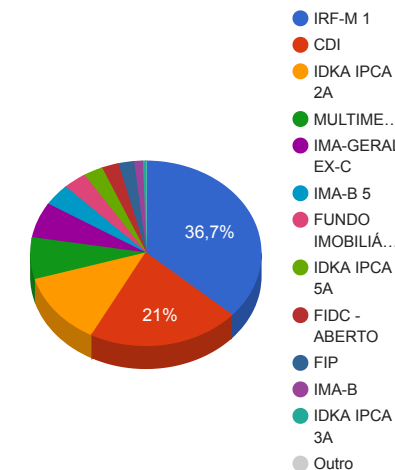
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (março / 2019) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	62.173.970,14	45,34%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.461.962,99	44,09%
Foco DTVM	4.523.343,70	3,30%
RJI Corretora de Valores	3.725.599,42	2,72%
Planner Corretora	3.217.763,04	2,35%
BNY Mellon Serviços Financeiros	3.009.833,82	2,20%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	8.663,21	0,01%

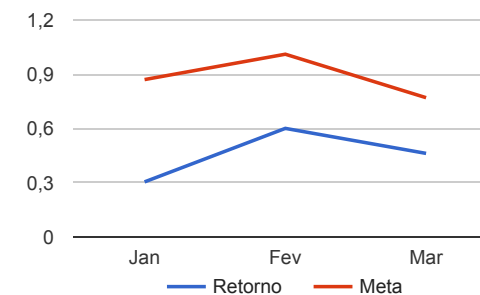
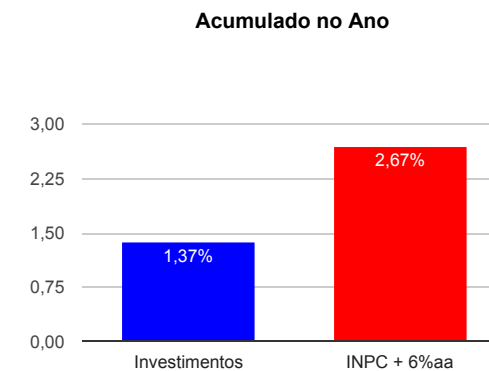


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	50.285.869,64	36,67%
CDI	28.852.253,63	21,04%
IDKA IPCA 2A	17.350.875,71	12,65%
MULTIMERCADO	9.992.978,41	7,29%
IMA-GERAL EX-C	8.538.846,88	6,23%
IMA-B 5	5.226.645,90	3,81%
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.523.343,70	3,30%
IDKA IPCA 5A	3.727.548,44	2,72%
FIDC - ABERTO	3.217.763,04	2,35%
FIP	3.009.833,82	2,20%
IMA-B	1.665.043,02	1,21%
IDKA IPCA 3A	721.470,92	0,53%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	8.663,21	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	134.553.696,18	679.903,12	571.250,18	135.073.206,15	410.857,03	0,31%	0,87%	35,00%	0,29%
Fevereiro	135.073.206,15	371.581,40	219.697,75	136.037.169,19	812.079,39	0,60%	1,01%	59,69%	0,44%
Março	136.037.169,19	546.490,73	102.315,61	137.112.473,11	631.128,80	0,46%	0,77%	59,92%	0,47%
Acumulado no ano					1.854.065,22	1,37%	2,67%	51,41%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.698.346,80	0,00	0,00	3.727.548,44	29.201,64	0,79%	1,75%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	434.689,59	0,00	0,00	438.008,77	3.319,18	0,76%	1,57%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.150.742,32	36.522,26	0,00	5.226.645,90	39.381,32	0,76%	1,21%	0,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.053.037,75	0,00	0,00	10.119.568,39	66.530,64	0,66%	0,93%	0,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.184.566,49	0,00	0,00	7.231.307,32	46.740,83	0,65%	0,89%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	717.246,97	0,00	0,00	721.470,92	4.223,95	0,59%	0,50%	0,59%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.220.219,12	0,00	0,00	1.227.034,25	6.815,13	0,56%	4,05%	0,56%
ILLUMINATI FIDC	3.200.874,06	0,00	0,00	3.217.763,04	16.888,98	0,53%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.494.743,16	0,00	0,00	8.538.846,88	44.103,72	0,52%	1,95%	0,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.101.425,01	0,00	0,00	15.171.853,34	70.428,33	0,47%	0,01%	0,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.301.057,14	0,00	0,00	11.353.147,18	52.090,04	0,46%	0,00%	0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	25.276.326,78	0,00	0,00	25.388.523,52	112.196,74	0,44%	0,09%	0,44%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.788.668,68	0,00	0,00	24.897.346,12	108.677,44	0,44%	0,11%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.911.348,88	509.968,47	102.315,61	2.327.253,11	8.251,37	0,34%	0,00%	0,39%
Total Renda Fixa					608.849,31	0,51%	0,49%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	4.069.987,50	0,00	0,00	4.085.220,99	15.233,49	0,37%	0,94%	0,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.175.112,00	0,00	0,00	2.182.158,00	7.046,00	0,32%	0,27%	0,32%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	3.009.833,82	0,00	0,00	3.009.833,82	0,00	0,00%	-	-
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	4.523.343,70	0,00	0,00	4.523.343,70	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.725.599,42	0,00	0,00	3.725.599,42	0,00	0,00%	0,11%	-0,21%
Total Renda Variável					22.279,49	0,13%	0,33%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	25.021.576,41	0,00	0,00	25.388.523,52	366.947,11	1,47%	1,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.539.186,12	0,00	0,00	24.897.346,12	358.160,00	1,46%	1,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.872.337,98	0,00	0,00	10.119.568,39	247.230,41	2,50%	2,50%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.295.249,89	0,00	0,00	8.538.846,88	243.596,99	2,94%	2,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.949.747,20	0,00	0,00	15.171.853,34	222.106,14	1,49%	1,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.055.491,87	0,00	0,00	7.231.307,32	175.815,45	2,49%	2,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.187.226,03	0,00	0,00	11.353.147,18	165.921,15	1,48%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.046.540,40	36.522,26	0,00	5.226.645,90	143.583,24	2,84%	2,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.705.001,51	0,00	96.522,52	3.727.548,44	119.069,45	3,23%	3,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.163.508,60	0,00	0,00	1.227.034,25	63.525,65	5,46%	5,46%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.509.233,92	1.561.452,99	765.206,73	2.327.253,11	21.772,93	0,99%	1,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	725.819,78	0,00	20.098,69	721.470,92	15.749,83	2,19%	2,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	436.048,16	0,00	11.435,60	438.008,77	13.396,21	3,09%	3,10%
ILLUMINATI FIDC	3.593.283,66	0,00	0,00	3.217.763,04	-375.520,62	-10,45%	-15,28%
Total Renda Fixa					1.781.353,94	1,52%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)	
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	4.021.937,22	0,00	0,00	4.085.220,99	63.283,77	1,57%	1,57%	
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.157.064,00	0,00	0,00	2.182.158,00	25.094,00	1,16%	1,16%	
ATICO FIC FIP FLORESTAL	3.009.833,82	0,00	0,00	3.009.833,82	0,00	0,00%	-	
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.725.599,42	0,00	0,00	3.725.599,42	0,00	0,00%	-3,30%	
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	4.539.010,19	0,00	0,00	4.523.343,70	-15.666,49	-0,35%	0,00%	
Total Renda Variável						72.711,28	0,42%	