

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

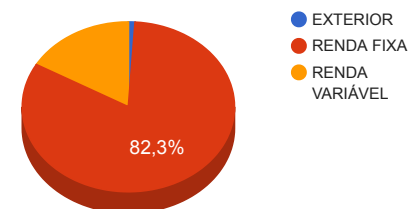
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	404.303,79	18,54%	420	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	358.598,02	16,45%	780	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	387.697,93	17,78%	1.263	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	325.387,63	14,92%	793	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	44.092,59	2,02%	306	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	273.871,28	12,56%	673	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	129.604,24	5,94%	133	0,03%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	151.153,63	6,93%	222	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	83.600,00	3,83%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	21.964,90	1,01%	71	0,01%	Artigo 9º - A, Inciso III
TOTAL -			2.180.274,01				

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

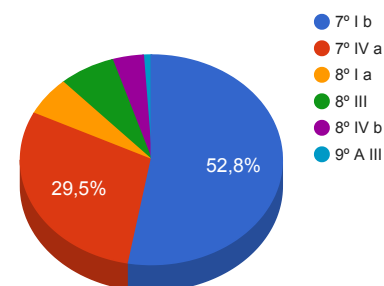
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.150.599,74	52,77%	20,00%	30,00%	100,00%	1.029.674,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.308.164,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	643.351,50	29,51%	10,00%	30,00%	40,00%	228.758,10
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	129.604,24	5,94%	0,00%	0,00%	0,00%	-129.604,24
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	436.054,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	151.153,63	6,93%	7,00%	10,00%	10,00%	66.873,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	83.600,00	3,83%	2,00%	5,00%	5,00%	25.413,70
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	21.964,90	1,01%	0,00%	0,00%	0,00%	-21.964,90
Total Carteira		2.180.274,01					

EXTERIOR	21.964,90	1,01%
RENDA FIXA	1.793.951,24	82,28%
RENDA VARIÁVEL	364.357,87	16,71%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.150.599,74	52,77%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	643.351,50	29,51%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
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 I, Alínea " a "	129.604,24	5,94%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	151.153,63	6,93%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	83.600,00	3,83%	2,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	21.964,90	1,01%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	2.180.274,01	100,00%	49,00	260,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.030.616,52	93,14%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	149.657,49	6,86%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,54%	1,54%	3,07%	6,93%	10,09%	24,15%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,52%	1,52%	3,02%	6,83%	9,88%	23,73%	0,20%	0,732%	3,05%
IDKA IPCA 2 Anos	1,26%	1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	1,22%	2,56%	5,85%	9,50%	22,93%	0,20%	0,607%	2,36%
IRF-M 1	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	0,58%	1,64%	3,60%	6,75%	17,55%	0,10%	0,109%	0,55%
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	0,53%	1,49%	3,10%	6,29%	16,40%	0,20%	0,003%	0,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	0,47%	1,33%	2,72%	5,50%	14,47%	0,80%	0,000%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	0,45%	1,27%	2,59%	5,24%	13,98%	1,00%	0,003%	0,01%

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

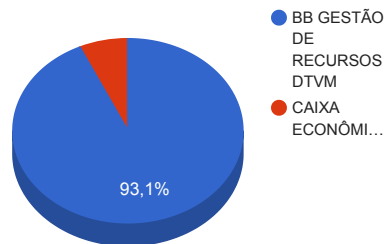
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	10,00%	10,00%	11,58%	24,31%	13,57%	49,19%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10,42%	10,42%	12,38%	25,18%	16,05%	51,30%	1,00%	8,141%	20,86%
IFIX	2,47%	2,47%	7,46%	11,85%	5,45%	24,55%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3,53%	3,53%	6,63%	6,65%	-10,30%	1,46%	1,20%	10,308%	21,26%
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,82%	0,82%	1,88%	3,28%	7,35%	20,99%	0,60%	0,364%	2,59%

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (janeiro / 2019)

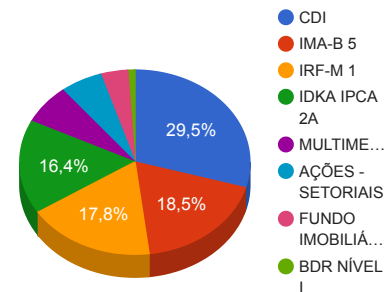
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	0,72%	0,72%	-2,63%	-5,99%	11,01%	43,91%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,66%	0,66%	-2,76%	-6,33%	9,21%	40,02%	0,70%	8,720%	18,82%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.030.616,52	93,14%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	149.657,49	6,86%



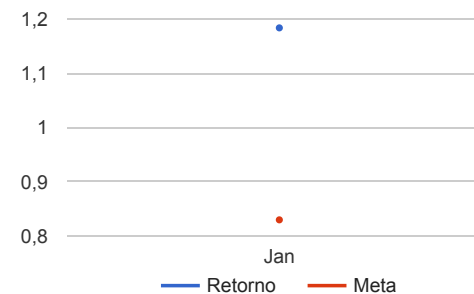
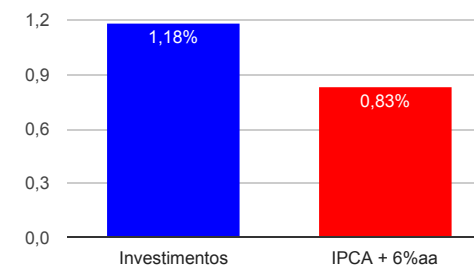
Sub-segmento	Valor	%
CDI	643.351,50	29,51%
IMA-B 5	404.303,79	18,54%
IRF-M 1	387.697,93	17,78%
IDKA IPCA 2A	358.598,02	16,45%
MULTIMERCADO	151.153,63	6,93%
AÇÕES - SETORIAIS	129.604,24	5,94%
FUNDO IMOBILIÁRIO	83.600,00	3,83%
BDR NÍVEL I	21.964,90	1,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	2.113.467,54	1.639.891,86	1.598.583,07	2.180.274,01	25.497,68	1,18%	0,83%	142,29%	1,25%
Acumulado no ano					25.497,68	1,18%	0,83%	142,29%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	140.855,40	310.000,00	50.000,00	404.303,79	3.448,39	0,76%	0,73%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	921.627,06	70.111,64	640.000,00	358.598,02	6.859,32	0,69%	0,61%	1,22%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	43.130,13	800,00	42,00	44.092,59	204,46	0,47%	0,00%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	262.414,08	258.566,80	135.000,00	387.697,93	1.717,05	0,33%	0,11%	0,58%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	209.029,91	295.000,00	180.000,00	325.387,63	1.357,72	0,27%	0,00%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	130.048,62	605.750,98	462.741,07	273.871,28	812,75	0,11%	0,00%	0,45%
Total Renda Fixa					14.399,69	0,81%	0,31%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	80.748,80	0,00	800,00	83.600,00	3.651,20	4,52%	10,31%	3,53%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	24.778,10	99.662,44	0,00	129.604,24	5.163,70	4,15%	8,14%	10,42%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	279.014,67	0,00	130.000,00	151.153,63	2.138,96	0,77%	0,36%	0,82%
Total Renda Variável					10.953,86	2,85%	5,41%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	21.820,77	0,00	0,00	21.964,90	144,13	0,66%	8,72%	0,66%
Total Exterior					144,13	0,66%	8,72%	