

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

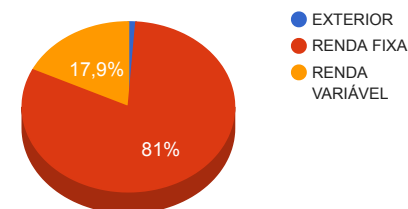
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	358.866,41	17,70%	438	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	318.472,98	15,71%	800	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	336.159,87	16,58%	1.249	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	311.752,30	15,38%	782	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	44.799,86	2,21%	313	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	271.796,73	13,41%	702	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	127.271,25	6,28%	142	0,03%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	152.052,51	7,50%	224	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	82.656,00	4,08%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	23.238,47	1,15%	69	0,01%	Artigo 9º - A, Inciso III
TOTAL -			2.027.066,38				

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

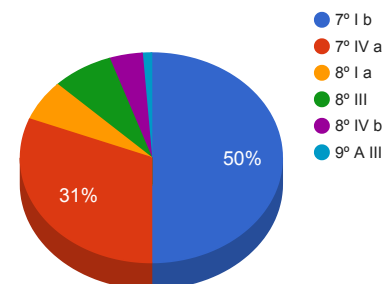
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.013.499,26	50,00%	20,00%	30,00%	100,00%	1.013.567,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.216.239,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	628.348,89	31,00%	10,00%	30,00%	40,00%	182.477,66
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	127.271,25	6,28%	0,00%	0,00%	0,00%	-127.271,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	405.413,28
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	152.052,51	7,50%	7,00%	10,00%	10,00%	50.654,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	82.656,00	4,08%	2,00%	5,00%	5,00%	18.697,32
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	23.238,47	1,15%	0,00%	0,00%	0,00%	-23.238,47
Total Carteira		2.027.066,38					

EXTERIOR	23.238,47	1,15%
RENTA FIXA	1.641.848,15	81,00%
RENTA VARIÁVEL	361.979,76	17,86%

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 "	1.013.499,26	50,00%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	628.348,89	31,00%	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 "	127.271,25	6,28%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	152.052,51	7,50%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	82.656,00	4,08%	2,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	23.238,47	1,15%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	2.027.066,38	100,00%	49,00	260,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.876.372,05	92,57%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	150.694,33	7,43%	0,00%

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
IMA-B 5	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	2,05%	3,43%	7,67%	9,88%	22,57%	0,20%	0,795%	3,04%
IDKA IPCA 2 Anos	0,53%	1,80%	3,07%	6,69%	10,19%	23,90%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	1,83%	3,07%	6,58%	9,55%	22,05%	0,20%	0,641%	2,35%
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,48%	1,02%	1,49%	3,03%	6,31%	15,93%	0,20%	0,007%	0,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	0,90%	1,33%	2,65%	5,52%	14,04%	0,80%	0,000%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,86%	1,27%	2,53%	5,27%	13,53%	1,00%	0,002%	0,01%
IRF-M 1	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-	-
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%

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

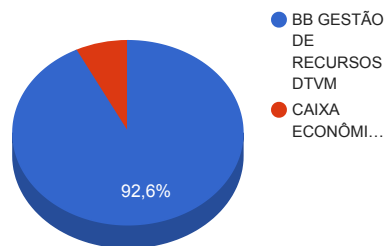
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,03%	3,53%	5,83%	13,80%	5,33%	20,00%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-1,13%	2,36%	1,69%	9,16%	-9,21%	-4,33%	1,20%	0,000%	21,26%
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,59%	1,42%	1,85%	4,43%	7,48%	21,77%	0,60%	0,297%	2,58%
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%

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

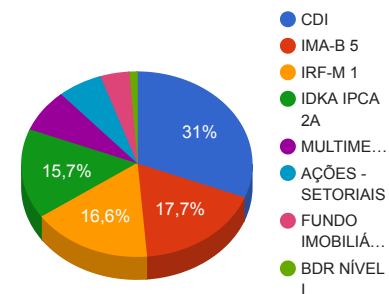
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	5,96%	6,73%	-1,52%	-11,92%	19,14%	47,52%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	5,80%	6,50%	-1,82%	-12,21%	17,20%	43,17%	0,70%	4,768%	18,28%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.876.372,05	92,57%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	150.694,33	7,43%



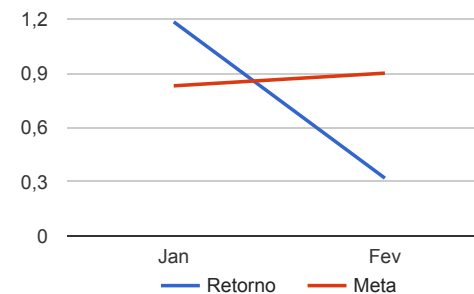
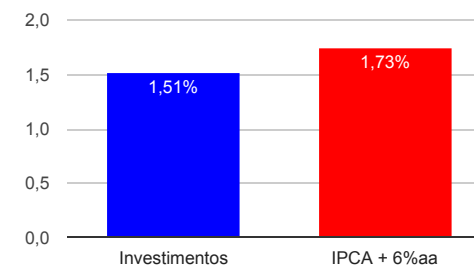
Sub-segmento	Valor	%
CDI	628.348,89	31,00%
IMA-B 5	358.866,41	17,70%
IRF-M 1	336.159,87	16,58%
IDKA IPCA 2A	318.472,98	15,71%
MULTIMERCADO	152.052,51	7,50%
AÇÕES - SETORIAIS	127.271,25	6,28%
FUNDO IMOBILIÁRIO	82.656,00	4,08%
BDR NÍVEL I	23.238,47	1,15%



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%
Fevereiro	2.180.274,01	370.961,31	531.152,35	2.027.066,38	6.983,41	0,32%	0,90%	35,77%	0,95%
Acumulado no ano					32.481,09	1,51%	1,73%	86,90%	

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	358.598,02	58.000,00	100.000,00	318.472,98	1.874,96	0,45%	0,64%	0,61%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	44.092,59	560,00	42,00	44.799,86	189,27	0,42%	0,00%	0,43%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	325.387,63	45.000,00	60.000,00	311.752,30	1.364,67	0,37%	0,01%	0,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	404.303,79	52.982,80	100.000,00	358.866,41	1.579,82	0,35%	0,80%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	387.697,93	47.042,42	100.000,00	336.159,87	1.419,52	0,33%	0,08%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	273.871,28	167.376,09	170.550,35	271.796,73	1.099,71	0,25%	0,00%	0,41%
Total Renda Fixa					7.527,95	0,42%	0,32%	

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 FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	151.153,63	0,00	0,00	152.052,51	898,88	0,59%	0,30%	0,59%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	83.600,00	0,00	560,00	82.656,00	-384,00	-0,46%	0,00%	-1,13%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	129.604,24	0,00	0,00	127.271,25	-2.332,99	-1,80%	9,80%	-1,80%
Total Renda Variável					-1.818,11	-0,50%	3,57%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 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	21.964,90	0,00	0,00	23.238,47	1.273,57	5,80%	4,77%	5,80%
Total Exterior					1.273,57	5,80%	4,77%	