

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2019)

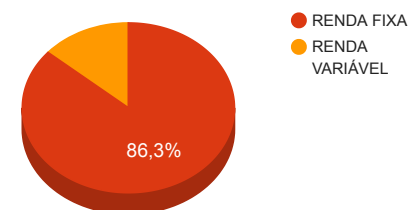
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	95.865,99	5,25%	811	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	254.376,23	13,92%	502	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	115.680,72	6,33%	852	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	201.773,13	11,04%	838	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	305.845,71	16,74%	1.248	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	331.795,56	18,16%	716	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	271.519,99	14,86%	774	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	168.884,66	9,24%	231	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	81.199,20	4,44%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			1.826.941,19				

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

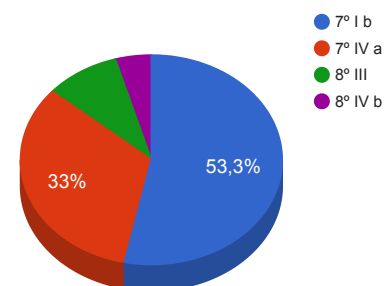
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	973.541,78	53,29%	20,00%	30,00%	100,00%	853.399,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.096.164,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	603.315,55	33,02%	10,00%	30,00%	40,00%	127.460,93
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	365.388,24
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	168.884,66	9,24%	7,00%	10,00%	10,00%	13.809,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	81.199,20	4,44%	2,00%	5,00%	5,00%	10.147,86
Total Carteira		1.826.941,19					

EXTERIOR	0,00	0,00%
RENTA FIXA	1.576.857,33	86,31%
RENTA VARIÁVEL	250.083,86	13,69%

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 "	973.541,78	53,29%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	603.315,55	33,02%	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 II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	168.884,66	9,24%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	81.199,20	4,44%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	1.826.941,19	100,00%	49,00	260,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.534.195,28	83,98%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	292.745,91	16,02%	0,00%

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	1,11%	4,03%	2,90%	5,65%	9,94%	22,26%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	3,94%	2,39%	5,48%	9,71%	22,29%	0,20%	0,640%	3,07%
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%

IDKA IPCA 2 Anos	1,03%	3,54%	2,48%	5,04%	9,41%	22,74%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,62%	2,38%	5,01%	9,10%	21,55%	0,20%	0,564%	2,36%
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%

CDI	0,52%	2,04%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	2,00%	1,46%	2,98%	6,22%	14,92%	0,20%	0,010%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,68%	1,23%	2,51%	5,21%	12,54%	1,00%	0,002%	0,01%

IRF-M 1	0,50%	2,03%	1,53%	3,19%	6,68%	16,65%	-	-	-
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%

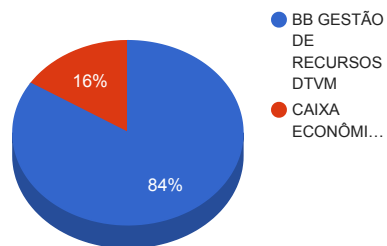
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,03%	6,67%	5,58%	12,29%	7,32%	22,14%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,69%	0,56%	-2,87%	3,57%	-3,33%	-0,00%	1,20%	4,373%	9,21%

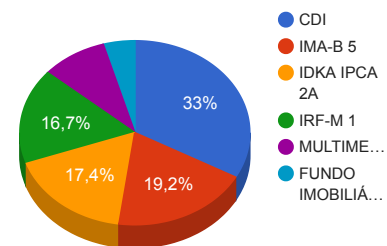
CDI	0,52%	2,04%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	2,66%	1,83%	3,74%	7,03%	18,36%	0,60%	0,300%	2,59%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.534.195,28	83,98%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	292.745,91	16,02%



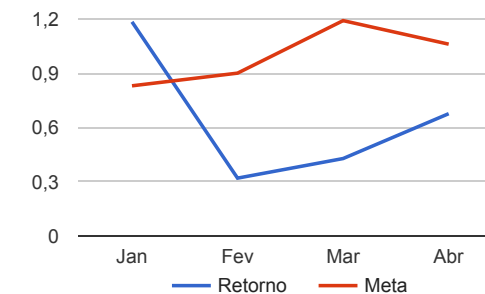
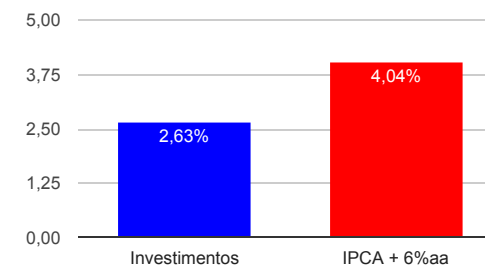
Sub-segmento	Valor	%
CDI	603.315,55	33,02%
IMA-B 5	350.242,22	19,17%
IDKA IPCA 2A	317.453,85	17,38%
IRF-M 1	305.845,71	16,74%
MULTIMERCADO	168.884,66	9,24%
FUNDO IMOBILIÁRIO	81.199,20	4,44%



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%
Março	2.027.066,38	503.324,08	1.065.984,56	1.473.091,30	8.685,40	0,43%	1,19%	35,90%	0,95%
Abril	1.473.091,30	806.549,88	464.970,03	1.826.941,19	12.270,04	0,68%	1,06%	63,82%	0,46%
Acumulado no ano					53.436,53	2,63%	4,04%	65,14%	

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(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	268.901,08	0,00	70.000,00	201.773,13	2.872,05	1,07%	0,56%	1,10%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	236.485,21	85.000,00	70.000,00	254.376,23	2.891,02	0,90%	0,64%	1,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	213.189,25	57.000,00	0,00	271.519,99	1.330,74	0,49%	0,01%	0,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	272.427,86	32.000,00	0,00	305.845,71	1.417,85	0,47%	0,09%	0,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.999,99	95.196,09	0,00	115.680,72	484,64	0,42%	0,56%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.490,93	70.000,00	0,00	95.865,99	375,06	0,39%	0,64%	1,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	257.861,92	367.353,79	295.097,81	331.795,56	1.677,66	0,27%	0,00%	0,43%
Total Renda Fixa					11.049,02	0,71%	0,27%	

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(%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4.602,35	0,00	4.685,85	0,00	83,50	1,81%	7,82%	0,71%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	67.712,68	100.000,00	0,00	168.884,66	1.171,98	0,70%	0,30%	0,79%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	81.760,00	0,00	560,00	81.199,20	-0,80	0,00%	4,37%	-0,69%
Total Renda Variável					1.254,68	0,50%	1,62%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	24.660,03	0,00	24.626,37	0,00	-33,66	-0,14%	6,82%	5,51%
Total Exterior					-33,66	-0,14%	0,00%	