

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

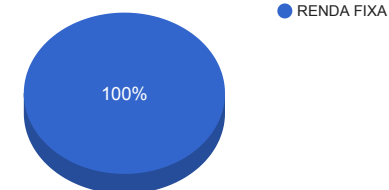
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.201.004,06	16,25%	758	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.426.771,01	17,39%	420	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.039.848,32	15,43%	738	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.298.248,36	16,74%	1.466	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.169.240,51	5,93%	419	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.885,60	0,01%	673	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.382.414,74	12,09%	823	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.184.089,40	16,16%	306	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
Total			19.704.502,00				

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

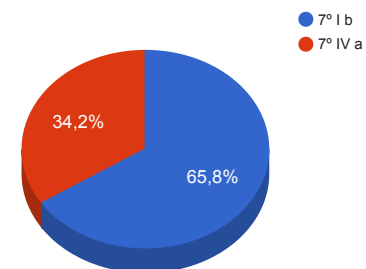
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.965.871,75	65,80%	15,00%	25,00%	100,00%	6.738.630,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	11.822.701,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.738.630,25	34,20%	5,00%	10,00%	40,00%	1.143.170,55
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	2.955.675,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	985.225,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	985.225,10
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	1.970.450,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	1.970.450,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,00%	10,00%	10,00%	1.970.450,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	985.225,10
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	985.225,10
Total Carteira		19.704.502,00					

RENDA FIXA	19.704.502,00	100,00%
------------	---------------	---------

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 "	12.965.871,75	65,80%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.738.630,25	34,20%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	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 I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	3,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	19.704.502,00	100,00%	39,00	270,00

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)

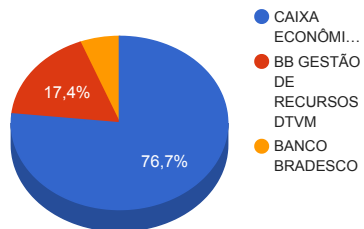
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.105.604,88	76,66%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.429.656,61	17,41%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.169.240,51	5,93%	0,00%

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

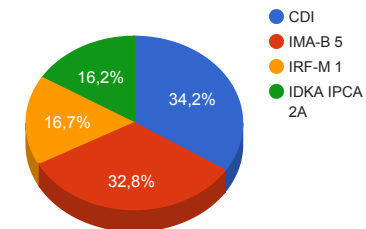
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,54%	1,54%	3,07%	6,93%	10,09%	24,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,53%	1,53%	3,07%	6,88%	9,91%	23,73%	0,20%	0,735%	3,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,52%	1,52%	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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	1,27%	2,57%	5,93%	9,64%	23,04%	0,20%	0,592%	2,36%
IRF-M 1	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,65%	3,62%	6,80%	17,67%	0,20%	0,099%	0,55%
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	0,53%	1,50%	3,07%	6,19%	16,16%	0,20%	0,002%	0,02%
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%
Selic	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,39%	16,38%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	0,53%	1,51%	3,10%	6,29%	16,69%	0,20%	0,001%	0,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.105.604,88	76,66%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.429.656,61	17,41%
BANCO BRADESCO	1.169.240,51	5,93%



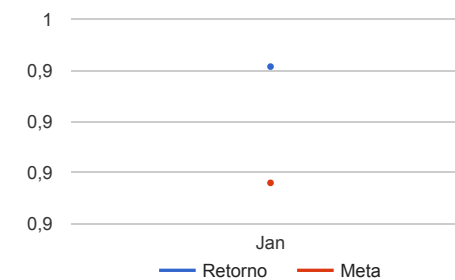
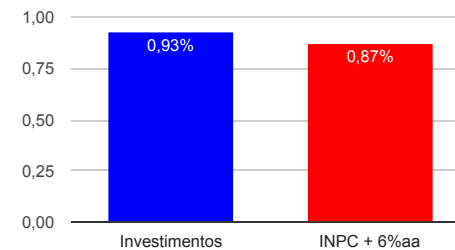
Sub-segmento	Valor	%
CDI	6.738.630,25	34,20%
IMA-B 5	6.466.619,33	32,82%
IRF-M 1	3.298.248,36	16,74%
IDKA IPCA 2A	3.201.004,06	16,25%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.937.835,05	2.044.432,93	458.719,08	19.704.502,00	180.953,10	0,93%	0,87%	106,31%	0,35%
Acumulado no ano					180.953,10	0,93%	0,87%	106,31%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.993.953,71	0,00	0,00	3.039.848,32	45.894,61	1,53%	0,74%	1,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.375.467,21	0,00	0,00	3.426.771,01	51.303,80	1,52%	0,73%	1,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.160.986,22	0,00	0,00	3.201.004,06	40.017,84	1,27%	0,59%	1,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.279.623,19	0,00	0,00	3.298.248,36	18.625,17	0,57%	0,10%	0,57%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.163.035,11	0,00	0,00	1.169.240,51	6.205,40	0,53%	0,00%	0,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.369.879,29	0,00	0,00	2.382.414,74	12.535,45	0,53%	0,00%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.872,73	0,00	0,00	2.885,60	12,87	0,45%	0,00%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.592.017,59	2.044.432,93	458.719,08	3.184.089,40	6.357,96	0,17%	0,00%	0,47%
				Total Renda Fixa	180.953,10	0,93%	0,35%	