

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

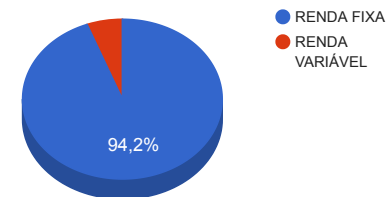
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.758.968,66	11,67%	1.466	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	731.920,95	1,79%	665	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.199.700,55	10,30%	233	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.664.172,65	4,08%	184	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.790.037,60	6,84%	223	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.277.977,31	3,13%	217	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.884.992,40	7,07%	1.263	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	435.708,90	1,07%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.102.754,59	2,70%	738	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.392.459,79	5,87%	525	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.792.765,27	6,85%	420	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.606.675,25	6,39%	780	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	3.353.044,24	8,22%	272	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.825.764,07	9,38%	793	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	818.188,29	2,01%	101	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.423.788,31	3,49%	11	1,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.206.042,98	2,96%	16	0,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	166.846,89	0,41%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.045.796,00	2,56%	92	0,38%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.303.481,04	3,20%	151	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
Total			40.781.085,74				

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

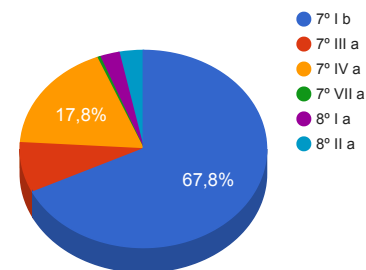
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	27.638.133,92	67,77%	15,00%	25,00%	70,00%	908.626,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	3.353.044,24	8,22%	5,00%	10,00%	60,00%	21.115.607,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.273.783,65	17,84%	10,00%	30,00%	40,00%	9.038.650,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	166.846,89	0,41%	2,00%	5,00%	5,00%	1.872.207,40
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	1.045.796,00	2,56%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.045.796,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.303.481,04	3,20%	7,00%	10,00%	20,00%	6.852.736,11
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	4.078.108,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.039.054,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.039.054,29
Total Carteira		40.781.085,74					

RENDA FIXA	38.431.808,70	94,24%
RENDA VARIÁVEL	2.349.277,04	5,76%

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 "	27.638.133,92	67,77%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	3.353.044,24	8,22%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.273.783,65	17,84%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	166.846,89	0,41%	2,00%	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 "	1.045.796,00	2,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.303.481,04	3,20%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	40.781.085,74	100,00%	50,00	240,00

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	18.656.311,19	45,75%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.024.615,33	44,20%	0,00%
ROMA ASSET	1.423.788,31	3,49%	0,32%
ITAÚ UNIBANCO	1.303.481,04	3,20%	0,00%
Elleven Gestora de Recursos	1.206.042,98	2,96%	0,10%
PETRA Capital	166.846,89	0,41%	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+	6,61%	6,61%	10,27%	20,14%	17,23%	35,69%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6,58%	6,58%	10,26%	19,95%	16,96%	34,73%	0,20%	2,744%	7,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6,53%	6,53%	10,06%	19,71%	16,75%	34,78%	0,20%	2,725%	7,86%

IMA-B	4,37%	4,37%	7,05%	14,01%	14,11%	30,65%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,36%	4,36%	7,01%	13,86%	13,82%	30,01%	0,20%	1,735%	5,46%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4,32%	4,32%	6,99%	13,87%	14,05%	29,93%	0,20%	1,723%	5,36%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,08%	2,37%	3,39%	10,95%	0,20%	0,429%	4,33%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,29%	0,29%	-4,37%	-3,89%	-5,09%	8,29%	1,30%	-	-

IMA Geral	1,91%	1,91%	3,88%	7,94%	10,20%	24,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,90%	1,90%	3,87%	7,82%	9,87%	23,60%	0,20%	0,765%	2,76%

IRF-M 1+	1,71%	1,71%	4,88%	9,90%	12,45%	29,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	1,66%	4,77%	9,80%	12,31%	29,12%	0,20%	1,398%	4,72%

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%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,75%	-0,75%	3,44%	5,73%	11,63%	27,26%	1,30%	1,122%	7,62%

IRF-M	1,39%	1,39%	3,96%	8,08%	10,83%	26,44%	-	-	-
-------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

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

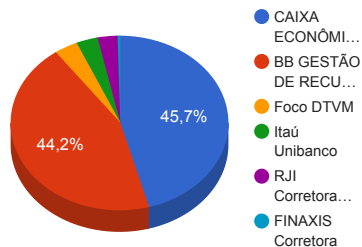
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	1,37%	3,91%	7,96%	10,62%	25,86%	0,20%	1,016%	3,39%
IDKA IPCA 2 Anos	1,26%	1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	1,22%	2,56%	5,85%	9,50%	22,93%	0,20%	0,607%	2,36%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,67%	0,67%	1,25%	3,15%	8,01%	15,59%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,14%	-0,14%	-0,54%	-1,35%	-7,88%	-11,05%	0,15%	0,026%	2,78%
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%
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%	-	-	-
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 ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	0,53%	1,49%	3,07%	6,07%	15,93%	0,20%	0,012%	0,07%

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

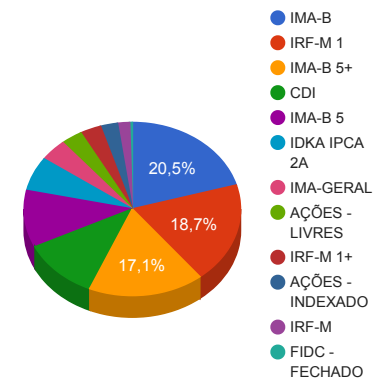
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	10,82%	10,82%	11,40%	22,94%	14,70%	50,60%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	8,29%	8,29%	15,51%	25,43%	26,66%	65,09%	2,50%	7,342%	19,20%
IBX-50	10,44%	10,44%	10,44%	21,80%	13,22%	49,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	10,63%	10,63%	10,10%	20,27%	11,09%	48,35%	0,70%	8,206%	22,08%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	18.656.311,19	45,75%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.024.615,33	44,20%
Foco DTVM	1.423.788,31	3,49%
Itaú Unibanco	1.303.481,04	3,20%
RJI Corretora de Valores	1.206.042,98	2,96%
FINAXIS Corretora	166.846,89	0,41%



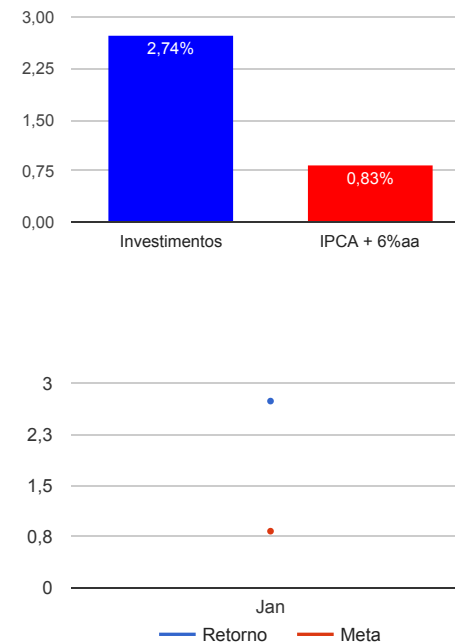
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	8.375.335,32	20,54%
IRF-M 1	7.643.961,06	18,74%
IMA-B 5+	6.989.738,15	17,14%
CDI	4.643.952,36	11,39%
IMA-B 5	4.331.228,76	10,62%
IDKA IPCA 2A	2.606.675,25	6,39%
IMA-GERAL	1.664.172,65	4,08%
AÇÕES - LIVRES	1.303.481,04	3,20%
IRF-M 1+	1.277.977,31	3,13%
AÇÕES - INDEXADO	1.045.796,00	2,56%
IRF-M	731.920,95	1,79%
FIDC - FECHADO	166.846,89	0,41%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	39.512.746,60	731.400,00	550.000,00	40.781.085,74	1.086.939,14	2,74%	0,83%	329,27%	1,47%
Acumulado no ano					1.086.939,14	2,74%	0,83%	329,27%	

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+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.617.739,69	0,00	0,00	2.790.037,60	172.297,91	6,58%	2,74%	6,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.942.374,39	0,00	0,00	4.199.700,55	257.326,16	6,53%	2,73%	6,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.292.593,50	0,00	0,00	2.392.459,79	99.866,29	4,36%	1,73%	4,36%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.214.186,26	0,00	0,00	3.353.044,24	138.857,98	4,32%	1,72%	4,32%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.633.206,48	0,00	0,00	1.664.172,65	30.966,17	1,90%	0,76%	1,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.257.103,89	0,00	0,00	1.277.977,31	20.873,42	1,66%	1,40%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.086.105,56	0,00	0,00	1.102.754,59	16.649,03	1,53%	0,74%	1,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.750.953,47	0,00	0,00	2.792.765,27	41.811,80	1,52%	0,73%	1,52%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	690.740,11	31.400,00	0,00	731.920,95	9.780,84	1,35%	1,02%	1,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.575.376,08	0,00	0,00	2.606.675,25	31.299,17	1,22%	0,61%	1,22%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	431.204,70	0,00	0,00	435.708,90	4.504,20	1,04%	0,43%	1,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.868.489,19	0,00	0,00	2.884.992,40	16.503,21	0,58%	0,11%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.732.094,82	0,00	0,00	4.758.968,66	26.873,84	0,57%	0,10%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.805.584,86	0,00	0,00	3.825.764,07	20.179,21	0,53%	0,00%	0,53%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	661.881,11	700.000,00	550.000,00	818.188,29	6.307,18	0,46%	0,01%	0,53%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.202.509,85	0,00	0,00	1.206.042,98	3.533,13	0,29%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	167.082,28	0,00	0,00	166.846,89	-235,39	-0,14%	0,03%	-0,14%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.434.510,08	0,00	0,00	1.423.788,31	-10.721,77	-0,75%	1,12%	-0,75%
Total Renda Fixa					886.672,38	2,36%	1,07%	

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 BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	945.291,11	0,00	0,00	1.045.796,00	100.504,89	10,63%	8,21%	10,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.203.719,17	0,00	0,00	1.303.481,04	99.761,87	8,29%	7,34%	8,29%
Total Renda Variável					200.266,76	9,32%	7,73%	