

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018

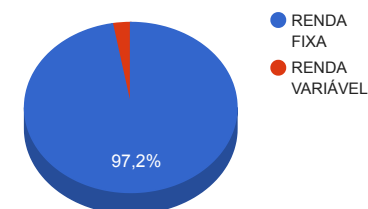
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	283.061,98	0,83%	698	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.600.964,38	7,66%	199	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.525.723,23	4,49%	203	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.352.421,93	6,93%	227	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.587.748,30	4,68%	213	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.589.556,54	7,63%	1.225	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	413.456,10	1,22%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.592.842,06	4,69%	716	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.119.069,32	9,19%	587	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.393.959,35	7,05%	727	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.417.878,41	7,12%	357	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	932.557,54	2,75%	1.417	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.550.057,26	10,46%	748	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	2.957.416,71	8,71%	310	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.955.833,49	5,76%	105	0,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.281.751,81	3,77%	13	0,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.277.298,92	3,76%	17	0,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	175.149,49	0,52%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	947.823,49	2,79%	73	0,91%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
		TOTAL -	33.954.570,31				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2018)

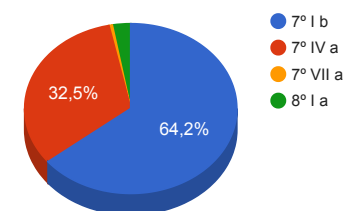
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	21.809.239,14	64,23%	15,00%	25,00%	70,00%	1.958.960,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	20.372.742,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.022.358,19	32,46%	5,00%	10,00%	30,00%	-835.987,10
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	5.093.185,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	175.149,49	0,52%	2,00%	5,00%	5,00%	1.522.579,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.697.728,52
Total Renda Fixa	100,00%	33.006.746,82	97,21%	36,00	70,00	190,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	947.823,49	2,79%	2,00%	5,00%	10,00%	2.447.633,54
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	3.395.457,03
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	3.395.457,03
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.697.728,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.697.728,52
Total Renda Variável	30,00%	947.823,49	2,79%	15,00	30,00	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	21.809.239,14	64,23%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.022.358,19	32,46%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	175.149,49	0,52%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	33.006.746,82	97,21%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	947.823,49	2,79%	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%	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 Variável	947.823,49	2,79%	15,00	40,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 2018)

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	16.706.004,79	49,20%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	14.514.365,30	42,75%	0,00%
ROMA ASSET	1.281.751,81	3,77%	0,43%
Elleven Gestora de Recursos	1.277.298,92	3,76%	0,39%
FINAXIS CORRETORA	175.149,49	0,52%	0,18%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,31%	2,88%	4,38%	6,02%	14,22%	47,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,41%	3,09%	4,52%	5,97%	13,86%	46,86%	0,20%	1,148%	5,87%
IRF-M	1,10%	2,42%	3,69%	5,42%	13,07%	39,45%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,40%	3,66%	5,32%	12,77%	38,94%	0,20%	0,815%	4,49%
IMA Geral	0,72%	2,48%	3,39%	4,91%	11,06%	34,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	2,42%	3,31%	4,72%	10,84%	34,56%	0,20%	0,800%	4,37%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	1,40%	2,58%	4,61%	12,44%	26,40%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	1,53%	2,40%	4,36%	11,42%	25,61%	0,20%	0,660%	2,69%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,61%	1,26%	2,03%	3,92%	7,01%	16,72%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-3,29%	-2,37%	-1,11%	-1,93%	-6,30%	-19,37%	0,15%	6,398%	4,22%
IMA-B 5+	0,56%	5,53%	6,36%	6,30%	10,78%	49,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	5,48%	6,28%	6,15%	10,58%	49,15%	0,20%	2,744%	11,78%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	5,48%	6,27%	6,12%	10,30%	49,08%	0,20%	2,734%	11,89%
IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,59%	3,92%	4,77%	5,45%	10,43%	39,60%	0,20%	1,827%	8,67%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	3,93%	4,77%	5,39%	10,57%	39,87%	0,20%	1,841%	9,07%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,52%	3,17%	4,46%	5,46%	11,56%	30,05%	1,30%	1,255%	4,54%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

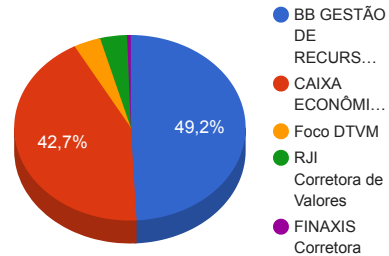
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,89%	-0,90%	0,14%	1,81%	6,18%	15,38%	0,20%	4,272%	5,11%
IRF-M 1	0,54%	1,14%	1,71%	3,74%	9,85%	25,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	1,68%	3,65%	9,68%	25,09%	0,20%	0,075%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	1,11%	1,68%	3,63%	9,62%	24,91%	0,10%	0,074%	0,65%
IMA-B 5	0,54%	1,88%	2,78%	4,42%	11,72%	26,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	1,85%	2,73%	4,32%	11,52%	26,20%	0,20%	0,783%	3,43%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	1,84%	2,72%	4,31%	11,55%	26,29%	0,20%	0,784%	3,45%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,50%	0,80%	2,03%	4,68%	14,01%	36,85%	1,30%	9,454%	10,97%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,47%	1,04%	1,63%	3,56%	9,05%	24,14%	0,20%	0,010%	0,12%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	0,97%	1,50%	3,38%	8,75%	23,81%	0,20%	0,035%	0,16%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

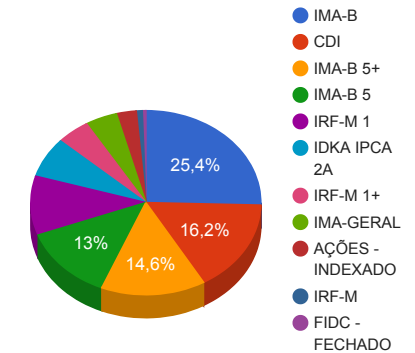
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	0,43%	12,19%	19,15%	21,02%	29,15%	97,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,68%	12,71%	19,77%	23,16%	30,41%	81,12%	0,70%	11,647%	19,87%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (fevereiro / 2018)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.706.004,79	49,20%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	14.514.365,30	42,75%
Foco DTVM	1.281.751,81	3,77%
RJI Corretora de Valores	1.277.298,92	3,76%
FINAXIS Corretora	175.149,49	0,52%



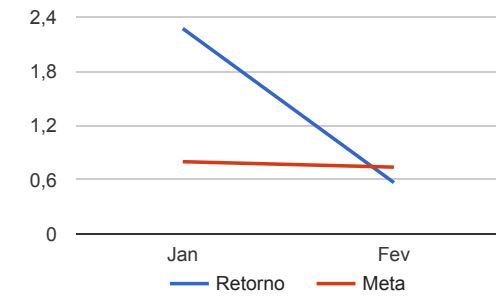
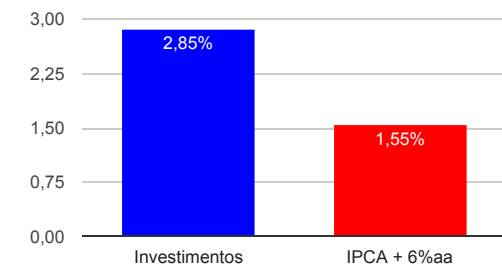
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	8.635.536,76	25,43%
CDI	5.505.890,75	16,22%
IMA-B 5+	4.953.386,31	14,59%
IMA-B 5	4.424.176,57	13,03%
IRF-M 1	3.522.114,08	10,37%
IDKA IPCA 2A	2.393.959,35	7,05%
IRF-M 1+	1.587.748,30	4,68%
IMA-GERAL	1.525.723,23	4,49%
AÇÕES - INDEXADO	947.823,49	2,79%
IRF-M	283.061,98	0,83%
FIDC - FECHADO	175.149,49	0,52%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	32.650.414,95	662.400,00	450.144,31	33.608.856,98	746.186,34	2,27%	0,80%	283,31%	1,70%
Fevereiro	33.608.856,98	617.800,00	464.435,26	33.954.570,31	192.348,59	0,57%	0,74%	77,15%	1,79%
Acumulado no ano					938.534,93	2,85%	1,55%	184,58%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.565.683,45	0,00	0,00	1.587.748,30	22.064,85	1,41%	1,15%	1,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	279.973,89	0,00	0,00	283.061,98	3.088,09	1,10%	0,81%	1,10%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.514.726,77	0,00	0,00	1.525.723,23	10.996,46	0,73%	0,80%	0,73%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	421.414,20	0,00	10.662,85	413.456,10	2.704,75	0,64%	4,27%	-1,89%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.939.962,65	0,00	0,00	2.957.416,71	17.454,06	0,59%	1,83%	0,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.380.616,40	0,00	0,00	2.393.959,35	13.342,95	0,56%	0,66%	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.586.898,64	0,00	0,00	2.600.964,38	14.065,74	0,54%	2,74%	0,54%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.339.854,66	0,00	0,00	2.352.421,93	12.567,27	0,54%	2,73%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	927.606,18	0,00	0,00	932.557,54	4.951,36	0,53%	0,07%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.584.416,53	0,00	0,00	1.592.842,06	8.425,53	0,53%	0,78%	0,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.102.639,85	0,00	0,00	3.119.069,32	16.429,47	0,53%	1,84%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.576.040,35	0,00	0,00	2.589.556,54	13.516,19	0,52%	0,07%	0,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.387.554,67	17.800,00	0,00	2.417.878,41	12.523,74	0,52%	0,78%	0,52%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.270.685,08	0,00	0,00	1.277.298,92	6.613,84	0,52%	1,25%	0,52%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.275.415,25	0,00	0,00	1.281.751,81	6.336,56	0,50%	9,45%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.533.530,34	0,00	0,00	3.550.057,26	16.526,92	0,47%	0,01%	0,47%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.799.340,26	600.000,00	450.000,00	1.955.833,49	6.493,23	0,27%	0,03%	0,40%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	181.116,73	0,00	3.772,41	175.149,49	-2.194,83	-1,21%	6,40%	-3,29%
Total Renda Fixa					185.906,18	0,57%	1,51%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	941.381,08	0,00	0,00	947.823,49	6.442,41	0,68%	11,65%	0,68%
Total Renda Variável					6.442,41	0,68%	11,65%	