

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2019)

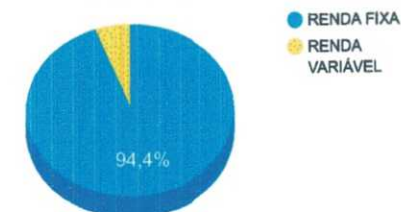
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.515,47	0,01%			Artigo 20
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	345.591,81	2,58%	552	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.930.471,16	14,44%	852	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	963.873,59	7,21%	811	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	568.421,60	4,25%	502	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.289.048,55	17,12%	1.248	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.049.266,37	7,85%	838	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.180.958,27	16,31%	1.449	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	477.596,55	3,57%	86	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	111.486,38	0,83%	88	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	41.433,91	0,31%	161.653	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	155.268,19	1,16%	716	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.603.328,65	11,99%	33	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	911.180,19	6,81%	454	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	322.078,87	2,41%	4.480	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	421.519,56	3,15%		0,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			13.373.039,12				

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

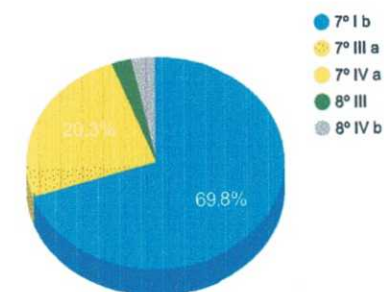
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	9.327.831,35	69,75%	20,00%	30,00%	80,00%	1.370.799,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	589.082,93	4,41%	5,00%	10,00%	60,00%	7.434.740,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	2.711.210,94	20,27%	10,00%	30,00%	40,00%	2.638.004,71
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	2.674.607,82
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	322.078,87	2,41%	0,00%	10,00%	10,00%	1.015.225,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	421.519,56	3,15%	0,00%	5,00%	5,00%	247.132,40
Total Carteira		13.371.523,65					

RENDA FIXA	12.629.440,69	94,45%
RENDA VARIÁVEL	743.598,43	5,56%

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 "	9.327.631,35	69,75%	20,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	589.082,93	4,41%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.711.210,94	20,27%	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	322.078,87	2,41%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	421.519,56	3,15%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	13.371.523,65	99,99%	35,00	240,00

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)

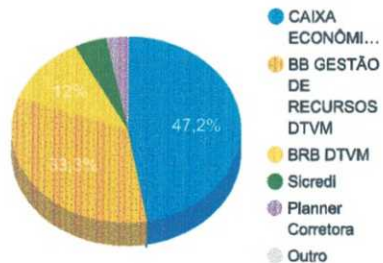
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.308.562,08	47,17%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.449.030,43	33,27%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	1.603.328,65	11,99%	0,23%
SICREDI	589.082,93	4,41%	0,00%
ZION Invest	421.519,56	3,15%	0,09%

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

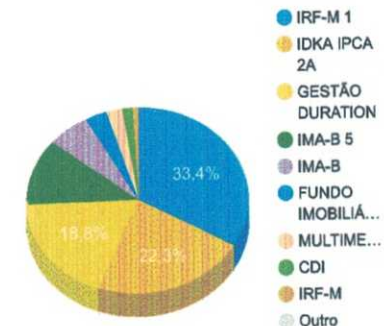
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (abril / 2019) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.308.562,08	47,17%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.449.030,43	33,27%
BRB DTVM	1.603.328,65	11,99%
Sicredi	589.082,93	4,41%
Planner Corretora	421.519,56	3,15%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.515,47	0,01%



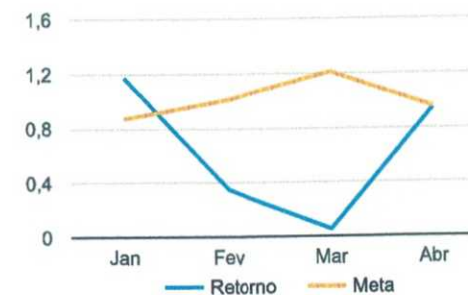
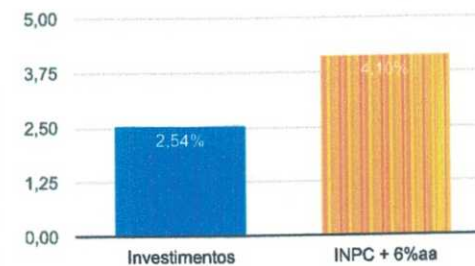
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.470.006,82	33,43%
IDKA IPCA 2A	2.979.737,53	22,28%
GESTÃO DURATION	2.514.508,84	18,80%
IMA-B 5	1.532.295,19	11,46%
IMA-B	823.188,36	6,16%
FUNDO IMOBILIÁRIO	421.519,56	3,15%
MULTIMERCADO	322.078,87	2,41%
CDI	196.702,10	1,47%
IRF-M	111.486,38	0,83%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.515,47	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	11.726.438,79	904.169,27	665.241,06	12.105.450,53	140.083,53	1,17%	0,87%	134,29%	1,05%
Fevereiro	12.105.450,53	1.082.388,43	498.426,98	12.733.903,33	44.491,35	0,35%	1,01%	34,85%	0,56%
Março	12.733.903,33	1.370.946,14	891.419,68	13.220.992,84	7.563,05	0,06%	1,21%	4,72%	1,68%
Abril	13.220.992,84	457.569,66	431.659,37	13.371.523,65	124.620,52	0,94%	0,95%	99,13%	1,16%
Acumulado no ano					316.758,45	2,54%	4,10%	61,90%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	340.498,28	0,00	0,00	345.591,81	5.093,53	1,50%	1,63%	1,50%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	470.593,81	0,00	0,00	477.596,55	7.002,74	1,49%	1,67%	1,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	701.203,10	200.000,00	0,00	911.180,19	9.977,09	1,11%	1,41%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.037.801,34	0,00	0,00	1.049.266,37	11.465,03	1,10%	0,56%	1,10%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	562.319,43	0,00	0,00	568.421,60	6.102,17	1,09%	0,64%	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	953.592,81	0,00	0,00	963.873,59	10.280,78	1,08%	0,64%	1,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.910.073,91	0,00	0,00	1.930.471,16	20.397,25	1,07%	0,56%	1,07%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.591.844,74	0,00	0,00	1.603.328,65	11.483,91	0,72%	0,33%	0,72%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	110.827,85	0,00	0,00	111.486,38	658,53	0,59%	0,85%	0,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.170.075,88	0,00	0,00	2.180.958,27	10.882,39	0,50%	0,08%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.277.898,31	0,00	0,00	2.289.048,55	11.350,24	0,50%	0,09%	0,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	326.072,32	139.223,69	311.026,70	155.268,19	998,88	0,21%	0,00%	0,43%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	43.565,70	118.345,97	120.632,67	41.433,91	154,91	0,10%	0,00%	0,18%
Total Renda Fixa					105.847,45	0,85%	0,50%	

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(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	405.096,72	0,00	0,00	421.519,56	16.422,84	4,05%	20,08%	4,05%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	319.728,64	0,00	0,00	322.078,87	2.350,23	0,74%	2,24%	0,74%
				Total Renda Variável	18.773,07	2,59%	12,35%	

