

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

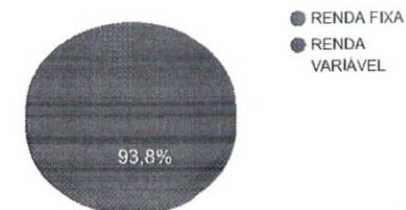
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.505,20	0,01%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.160.485,90	16,96%	1.463	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.897.516,22	14,90%	799	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	338.607,10	2,66%	538	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	558.090,72	4,38%	438	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	946.358,33	7,43%	762	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.267.756,11	17,81%	1.249	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.031.093,33	8,10%	800	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	468.201,33	3,68%	77	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	110.200,92	0,87%	66	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	25.353,57	0,20%	159.823	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	561.847,85	4,41%	702	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.584.078,15	12,44%	33	1,87%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	319.000,00	2,50%	4.356	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	465.313,80	3,65%		0,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			12.735.408,53				

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

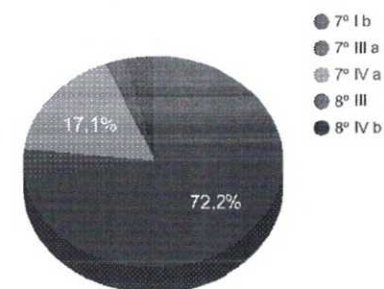
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	9.199.907,71	72,24%	20,00%	30,00%	80,00%	988.419,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	578.402,25	4,54%	5,00%	10,00%	60,00%	7.062.842,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	2.171.279,57	17,05%	10,00%	30,00%	40,00%	2.922.883,84
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	2.547.081,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	319.000,00	2,50%	0,00%	10,00%	10,00%	954.540,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	465.313,80	3,65%	0,00%	5,00%	5,00%	171.456,63
Total Carteira		12.733.903,33					

RENDA FIXA	11.951.094,73	93,85%
RENDA VARIÁVEL	784.313,80	6,16%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	9.199.907,71	72,24%	20,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	578.402,25	4,54%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.171.279,57	17,05%	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	319.000,00	2,50%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	465.313,80	3,65%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	12.733.903,33	99,99%	35,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 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	5.323.360,45	41,80%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.782.748,68	37,55%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	1.584.078,15	12,44%	0,23%
SICREDI	578.402,25	4,54%	0,00%
ZION Invest	465.313,80	3,65%	2,76%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	0,55%	7,20%	9,21%	21,43%	17,23%	29,86%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,49%	2,12%	2,91%	7,82%	8,12%	26,34%	0,50%	0,465%	3,55%
IMA-B	0,55%	4,94%	6,67%	15,14%	14,11%	26,50%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,87%	6,57%	14,95%	13,78%	25,82%	0,20%	2,433%	5,52%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,49%	4,74%	6,50%	15,00%	13,94%	25,85%	0,20%	2,452%	5,48%
IMA-B 5	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	2,05%	3,43%	7,67%	9,88%	22,57%	0,20%	0,795%	3,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	2,06%	3,47%	7,74%	9,90%	22,57%	0,20%	0,793%	3,06%
IDKA IPCA 2 Anos	0,53%	1,80%	3,07%	6,69%	10,19%	23,90%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	1,83%	3,07%	6,58%	9,55%	22,05%	0,20%	0,641%	2,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	1,83%	3,01%	6,51%	9,63%	22,15%	0,20%	0,632%	2,36%
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,86%	1,27%	2,53%	5,27%	13,53%	1,00%	0,002%	0,01%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,17%	0,36%	0,54%	1,07%	2,22%	7,07%	4,00%	0,003%	0,01%
IRF-M 1	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	1,02%	1,57%	3,66%	6,71%	17,04%	0,20%	0,083%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,02%	1,56%	3,65%	6,65%	16,91%	0,10%	0,083%	0,55%

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

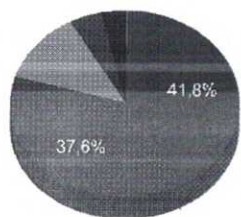
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	0,29%	1,68%	3,24%	9,41%	9,94%	24,31%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,27%	1,69%	3,22%	9,55%	9,94%	24,03%	0,20%	1,000%	3,47%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,31%	3,06%	2,78%	8,61%	7,27%	21,99%	1,00%	2,852%	6,27%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-2,86%	-1,16%	-7,61%	-10,95%	-17,07%	14,86%	1,60%	0,000%	89,77%

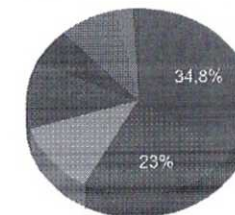
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (fevereiro / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.323.360,45	41,80%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.782.748,68	37,55%
BRB DTVM	1.584.078,15	12,44%
Sicredi	578.402,25	4,54%
Planner Corretora	465.313,80	3,65%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.505,20	0,01%



- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BRB DTVM
- Sicredi
- Planner Corretora
- Outro

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.428.242,01	34,77%
IDKA IPCA 2A	2.928.609,55	23,00%
GESTÃO DURATION	1.584.078,15	12,44%
IMA-B 5	1.504.449,05	11,81%
IMA-B	806.808,43	6,34%
CDI	587.201,42	4,61%
FUNDO IMOBILIÁRIO	465.313,80	3,65%
MULTIMERCADO	319.000,00	2,50%
IRF-M	110.200,92	0,87%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.505,20	0,01%

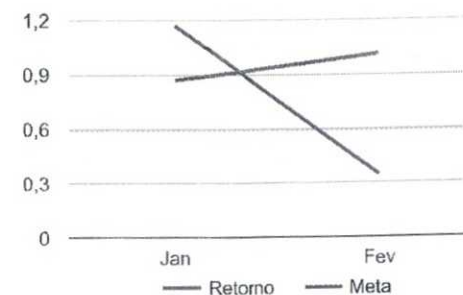
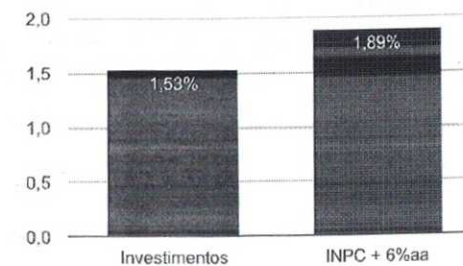


- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- GESTÃO DURATION
- IMA-B 5
- IMA-B
- CDI
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- MULTIMERCADO
- IRF-M
- Outro

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%
Acumulado no ano					184.574,88	1,53%	1,89%	80,86%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 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	1.024.875,18	0,00	0,00	1.031.093,33	6.218,15	0,61%	0,64%	0,61%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.886.999,65	0,00	0,00	1.897.516,22	10.516,57	0,56%	0,63%	0,56%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	555.179,55	0,00	0,00	558.090,72	2.911,17	0,52%	0,80%	0,52%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	941.426,40	0,00	0,00	946.358,33	4.931,93	0,52%	0,79%	0,52%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	336.934,46	0,00	0,00	338.607,10	1.672,64	0,50%	2,43%	0,50%	
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	465.899,69	0,00	0,00	468.201,33	2.301,64	0,49%	2,45%	0,49%	
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.576.386,66	0,00	0,00	1.584.078,15	7.691,49	0,49%	0,46%	0,49%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.150.857,06	0,00	0,00	2.160.485,90	9.628,84	0,45%	0,08%	0,45%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.257.848,26	0,00	0,00	2.267.756,11	9.907,85	0,44%	0,08%	0,44%	
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	109.904,92	0,00	0,00	110.200,92	296,00	0,27%	1,00%	0,27%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	275.442,24	683.388,43	399.010,18	561.847,85	2.027,36	0,21%	0,00%	0,41%	
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	44.696,96	80.000,00	99.416,80	25.353,57	73,41	0,06%	0,00%	0,17%	
Total Renda Fixa						58.177,05	0,49%	0,52%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	319.000,00	0,00	319.000,00	0,00	0,00%	2,85%	-0,31%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	478.999,50	0,00	0,00	465.313,80	-13.685,70	-2,86%	0,00%	-2,86%
Total Renda Variável					-13.685,70	-1,72%	1,16%	