

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018



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

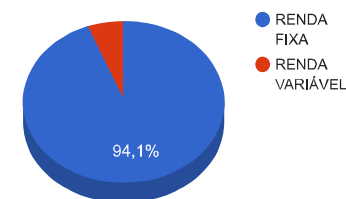
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5,57	0,00%			Artigo 20
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.324.293,00	12,87%	357	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	673.014,67	6,54%	727	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	749.851,26	7,29%	745	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.054.940,76	19,97%	1.417	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.117.523,34	10,86%	632	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	39.109,74	0,38%	1.225	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	1.049.245,26	10,20%	398	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	156.259,27	1,52%	99	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	98.272,06	0,96%	239	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.046.176,38	10,17%	105	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.548,36	0,20%	655	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.353.063,80	13,15%	144	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	209.304,37	2,03%	885	0,32%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	396.469,92	3,85%	3.045	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	10.288.077,76				

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

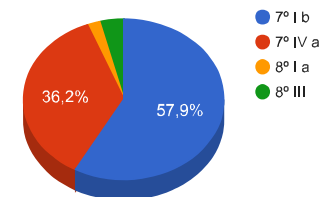
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	5.958.732,77	57,92%	20,00%	30,00%	70,00%	1.242.921,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	6.172.846,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	3.723.565,13	36,19%	5,00%	10,00%	30,00%	-637.141,80
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	1.543.211,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	514.403,89
Total Renda Fixa	100,00%	9.682.297,90	94,11%	39,00	70,00	185,00	-

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%	209.304,37	2,03%	2,00%	5,00%	10,00%	819.503,41
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	1.028.807,78
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	396.469,92	3,85%	7,00%	10,00%	10,00%	632.337,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	514.403,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	514.403,89
Total Renda Variável	30,00%	605.774,29	5,89%	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 "	5.958.732,77	57,92%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.723.565,13	36,19%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
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	9.682.297,90	94,11%	39,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	209.304,37	2,03%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	396.469,92	3,85%	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	605.774,29	5,89%	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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.865.542,78	76,45%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.056.965,77	19,99%	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	365.563,64	3,55%	-

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
IPCA + 6,00% ao ano	0,74%	1,55%	2,47%	4,82%	8,94%	20,97%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,43%	1,27%	1,93%	3,78%	10,32%	26,74%	0,30%	0,369%	2,12%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	1,40%	2,58%	4,61%	12,44%	26,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	1,53%	2,41%	4,33%	11,41%	25,72%	0,20%	0,651%	2,63%
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%
IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,55%	3,95%	4,83%	5,44%	10,83%	40,77%	0,20%	1,877%	9,20%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	3,93%	4,77%	5,39%	10,63%	39,99%	0,20%	1,843%	9,06%
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%	-	-	-
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%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	0,92%	1,39%	3,08%	8,07%	22,06%	0,80%	0,003%	0,11%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	0,88%	1,33%	2,95%	7,85%	21,90%	1,00%	0,007%	0,11%

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

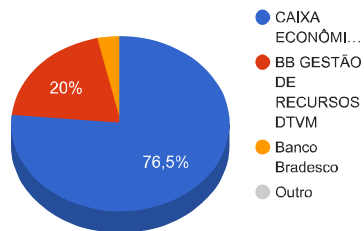
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,64%	1,66%	2,47%	4,01%	10,06%	-	0,002	0,447%	4,23%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

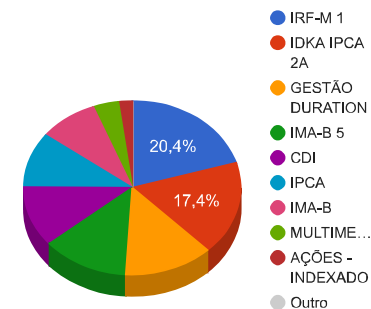
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-	-
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	2,02%	14,93%	21,10%	25,17%	34,81%	117,06%	2,00%	12,054%	21,53%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,53%	3,85%	5,99%	8,13%	13,72%	40,29%	1,00%	3,048%	6,41%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.865.542,78	76,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.056.965,77	19,99%
Banco Bradesco	365.563,64	3,55%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5,57	0,00%



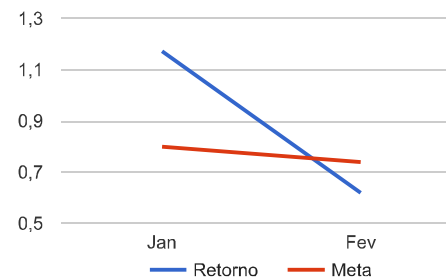
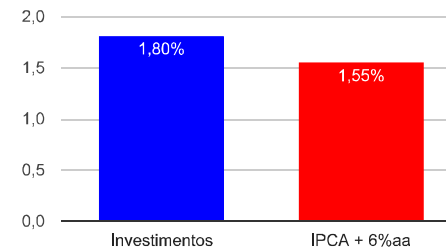
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.094.050,50	20,35%
IDKA IPCA 2A	1.790.538,01	17,40%
GESTÃO DURATION	1.353.063,80	13,15%
IMA-B 5	1.324.293,00	12,87%
CDI	1.164.996,80	11,32%
IPCA	1.049.245,26	10,20%
IMA-B	906.110,53	8,81%
MULTIMERCADO	396.469,92	3,85%
AÇÕES - INDEXADO	209.304,37	2,03%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5,57	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	9.590.169,76	198.960,47	36.077,37	9.867.249,76	114.196,90	1,17%	0,80%	146,09%	0,52%
Fevereiro	9.867.249,76	427.760,02	70.316,47	10.288.072,19	63.378,88	0,62%	0,74%	83,95%	0,86%
Acumulado no ano					177.575,78	1,80%	1,55%	116,32%	

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.227.664,08	116.859,98	0,00	1.353.063,80	8.539,74	0,64%	0,45%	0,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.111.229,34	0,00	0,00	1.117.523,34	6.294,00	0,57%	0,65%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	669.263,56	0,00	0,00	673.014,67	3.751,11	0,56%	0,66%	0,56%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	155.407,83	0,00	0,00	156.259,27	851,44	0,55%	1,88%	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	745.812,52	0,00	0,00	749.851,26	4.038,74	0,54%	1,84%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.044.030,15	0,00	0,00	2.054.940,76	10.910,61	0,53%	0,07%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.905,61	0,00	0,00	39.109,74	204,13	0,52%	0,07%	0,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.317.440,73	0,00	0,00	1.324.293,00	6.852,27	0,52%	0,78%	0,52%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1.044.775,43	0,00	0,00	1.049.245,26	4.469,83	0,43%	0,37%	0,43%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.042.005,38	0,00	0,00	1.046.176,38	4.171,00	0,40%	0,03%	0,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	20.492,28	0,00	20.548,36	56,08	0,27%	0,01%	0,39%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	83.662,29	84.722,18	70.316,47	98.272,06	204,06	0,12%	0,00%	0,41%
Total Renda Fixa					50.343,01	0,52%	0,52%	

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(%)
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	198.288,00	0,00	209.304,37	11.016,37	5,56%	12,05%	2,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	387.052,84	7.397,58	0,00	396.469,92	2.019,50	0,51%	3,05%	0,53%
Total Renda Variável					13.035,87	2,20%	6,16%	