

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019



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 / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			194.716,45	0,17%			Artigo 20
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.810.825,22	2,47%	1.249	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.090.889,55	2,71%	799	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.010.038,96	8,79%	762	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.377.569,13	3,84%	1.463	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.816.459,94	13,89%	800	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.130.240,51	3,63%	301	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.279.626,19	4,64%	782	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.324.916,41	4,68%	93	2,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	7.552.900,66	6,63%	64	2,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	18.505.647,04	16,25%	387	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.129.766,65	1,87%	423	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.367.152,94	2,08%	33	1,11%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	4.718.667,63	4,14%	54	2,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.305.251,20	1,15%	74	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.046.405,14	1,80%	180	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.216.970,87	1,07%	151	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.087.361,91	2,71%	16	1,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+2	1280 dias	2.251.118,90	1,98%	13	9,68%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.182.021,42	1,92%	76	1,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	4.057.482,52	3,56%	1.943	0,88%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.260.447,97	1,99%	4.356	0,32%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

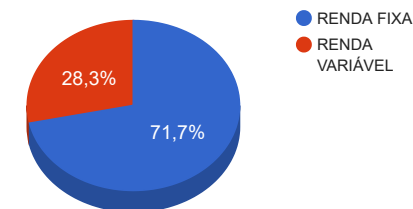
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.093.253,85	1,84%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.222.766,62	2,83%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	3.838.707,10	3,37%		2,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			113.871.204,78				

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

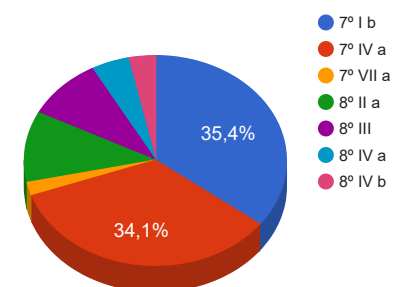
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	40.236.023,31	35,33%	15,00%	25,00%	78,00%	48.583.516,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	68.322.722,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	38.792.856,95	34,07%	10,00%	30,00%	40,00%	6.755.624,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.367.152,94	2,08%	2,00%	5,00%	5,00%	3.326.407,30
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	12.374.656,75	10,87%	5,00%	10,00%	20,00%	10.399.584,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.751.070,81	9,44%	5,00%	10,00%	10,00%	636.049,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.316.020,47	4,67%	2,00%	5,00%	5,00%	377.539,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.838.707,10	3,37%	2,00%	5,00%	5,00%	1.854.853,14
Total Carteira		113.676.488,33					

RENDA FIXA	81.590.749,65	71,77%
RENDA VARIÁVEL	32.280.455,13	28,40%

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 "	40.236.023,31	35,33%	15,00%	78,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	38.792.856,95	34,07%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.367.152,94	2,08%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	12.374.656,75	10,87%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	10.751.070,81	9,44%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.316.020,47	4,67%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.838.707,10	3,37%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	113.676.488,33	99,83%	41,00	263,00

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)

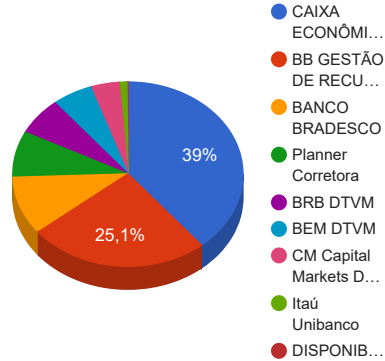
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	44.431.841,82	39,02%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	28.625.578,98	25,14%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.729.546,31	12,06%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	7.506.937,83	6,59%	1,11%
Horus GGR	4.618.271,84	4,06%	1,29%
ZION Invest	3.838.707,10	3,37%	22,74%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.222.766,62	2,83%	-
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	2.093.253,85	1,84%	48,35%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	1.305.251,20	1,15%	0,26%
ITAÚ UNIBANCO	1.216.970,87	1,07%	0,00%

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

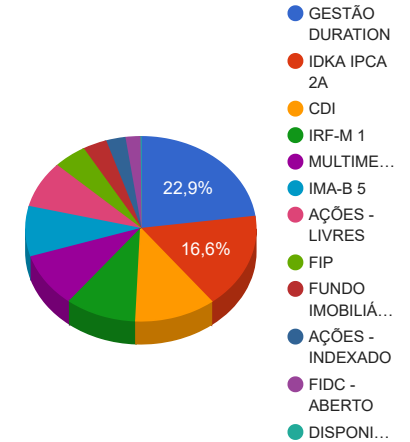
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (fevereiro / 2019) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	44.431.841,82	39,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	28.625.578,98	25,14%
BANCO BRADESCO	11.683.141,17	10,26%
Planner Corretora	9.154.727,57	8,04%
BRB DTVM	7.506.937,83	6,59%
BEM DTVM	6.439.018,25	5,65%
CM Capital Markets DTVM	4.618.271,84	4,06%
Itaú Unibanco	1.216.970,87	1,07%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	194.716,45	0,17%



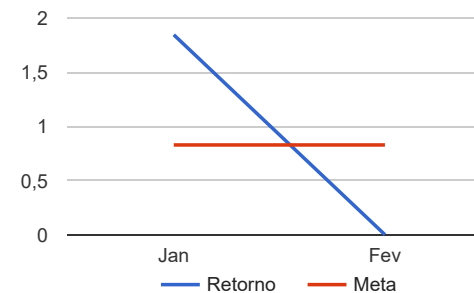
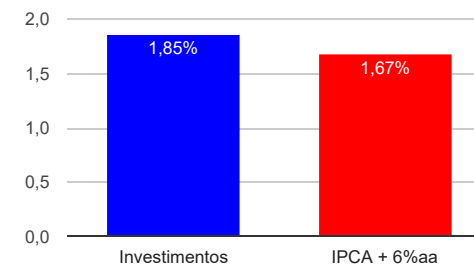
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	26.058.547,70	22,88%
IDKA IPCA 2A	18.907.349,49	16,60%
CDI	12.734.309,25	11,18%
IRF-M 1	11.318.634,86	9,94%
MULTIMERCADO	10.751.070,81	9,44%
IMA-B 5	10.010.038,96	8,79%
AÇÕES - LIVRES	9.287.294,84	8,16%
FIP	5.316.020,47	4,67%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.838.707,10	3,37%
AÇÕES - INDEXADO	3.087.361,91	2,71%
FIDC - ABERTO	2.367.152,94	2,08%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	194.716,45	0,17%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	109.368.962,66	1.435.363,81	311.385,50	112.530.385,60	2.037.444,63	1,84%	0,83%	221,73%	2,06%
Fevereiro	112.530.385,60	19.740.469,76	18.599.442,39	113.676.488,33	5.075,36	0,00%	0,83%	0,54%	2,49%
Acumulado no ano					2.042.519,99	1,85%	1,67%	110,68%	

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	15.721.076,62	0,00	0,00	15.816.459,94	95.383,32	0,61%	0,64%	0,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.073.758,97	0,00	0,00	3.090.889,55	17.130,58	0,56%	0,63%	0,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.254.159,96	0,00	0,00	5.279.626,19	25.466,23	0,48%	0,01%	0,48%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.119.728,17	0,00	0,00	2.129.766,65	10.038,48	0,47%	0,01%	0,47%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.300.639,79	0,00	0,00	5.324.916,41	24.276,62	0,46%	0,19%	0,46%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.111.918,02	0,00	0,00	4.130.240,51	18.322,49	0,45%	0,09%	0,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.798.544,70	0,00	0,00	2.810.825,22	12.280,52	0,44%	0,08%	0,44%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.432.779,11	8.000.000,00	0,00	18.505.647,04	72.867,93	0,40%	2,41%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.139.407,09	403.989,47	18.246.000,00	4.377.569,13	80.172,57	0,36%	0,08%	0,45%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.190.071,43	1.336.480,29	0,00	7.552.900,66	26.348,94	0,35%	1,06%	0,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.010.038,96	10.038,96	0,10%	0,79%	0,52%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.459.160,25	0,00	0,00	2.367.152,94	-92.007,31	-3,74%	6,92%	-3,74%
Total Renda Fixa					300.319,33	0,37%	1,12%	

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(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.171.954,00	0,00	0,00	2.182.021,42	10.067,42	0,46%	0,13%	0,46%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	4.039.968,56	0,00	0,00	4.057.482,52	17.513,96	0,43%	0,09%	0,43%
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	2.095.984,68	0,00	0,00	2.093.253,85	-2.730,83	-0,13%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.227.836,04	0,00	0,00	3.222.766,62	-5.069,42	-0,16%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.267.489,47	0,00	0,00	2.260.447,97	-7.041,50	-0,31%	2,85%	-0,31%
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.622.450,95	0,00	353.442,39	2.251.118,90	-17.889,66	-0,68%	23,04%	-14,16%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.068.312,53	0,00	0,00	2.046.405,14	-21.907,39	-1,06%	10,30%	-1,06%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4.777.501,82	0,00	0,00	4.718.667,63	-58.834,19	-1,23%	9,40%	-1,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.235.393,77	0,00	0,00	1.216.970,87	-18.422,90	-1,49%	9,59%	-1,49%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC AÇÕES	3.140.997,28	0,00	0,00	3.087.361,91	-53.635,37	-1,71%	9,66%	-1,71%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.329.642,14	0,00	0,00	1.305.251,20	-24.390,94	-1,83%	9,79%	-1,83%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	3.951.610,25	0,00	0,00	3.838.707,10	-112.903,15	-2,86%	0,00%	-2,86%
Total Renda Variável					-295.243,97	-0,90%	6,63%	