

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
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	5.416.105,96	3,88%	107	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	8.148.110,24	5,84%	223	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.503.268,38	10,40%	727	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.637.638,21	1,17%	357	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.307.191,12	1,65%	698	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.969.078,06	1,41%	227	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	3.138.171,09	2,25%	99	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.084.837,13	0,78%	1.225	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	204.540,36	0,15%	113	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.396.959,67	4,59%	72	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.614.410,12	9,05%	1.417	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	31.046.469,78	22,26%	632	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	507.040,81	0,36%	192	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.967.799,81	2,13%	716	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.284.350,58	5,22%	587	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.025.571,48	1,45%	46	1,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.560.371,99	1,12%	180	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.170.698,70	3,71%	199	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.619.054,16	3,31%	203	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.305.342,00	0,94%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.214.165,35	6,61%	745	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.896.060,12	1,36%	748	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

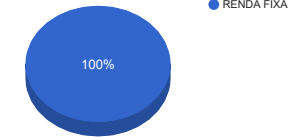
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.434.424,49	10,35%	239	2,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	139.451.659,61				

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

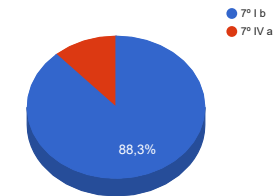
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	123.121.175,00	88,29%	15,00%	25,00%	100,00%	16.330.484,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	83.670.995,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	16.330.484,61	11,71%	5,00%	10,00%	40,00%	39.450.179,23
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	20.917.748,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.972.582,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.972.582,98
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	27.890.331,92
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	27.890.331,92
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	13.945.165,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.972.582,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.972.582,98
Total Carteira		139.451.659,61					

RENDA FIXA	139.451.659,61	100,00%
------------	----------------	---------

Distribuição por Segmento



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 "	123.121.175,00	88,29%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	16.330.484,61	11,71%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
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 I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	139.451.659,61	100,00%	20,00	290,00

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	101.333.540,28	72,67%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.118.119,33	27,33%	0,00%

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	1,10%	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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,74%	1,55%	2,47%	4,82%	8,94%	20,97%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,08%	-1,04%	-0,34%	1,85%	3,17%	8,63%	0,20%	4,802%	3,90%
IMA Geral ex-C	0,72%	2,41%	3,33%	4,83%	11,12%	35,03%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	2,49%	3,42%	4,65%	10,51%	-	0,30%	0,871%	4,83%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	2,41%	3,29%	4,71%	10,82%	34,58%	0,20%	0,796%	4,53%
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%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,28%	1,64%	3,39%	9,43%	22,90%	0,20%	0,356%	1,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,29%	1,64%	3,40%	9,45%	-	0,20%	0,359%	1,67%
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%

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

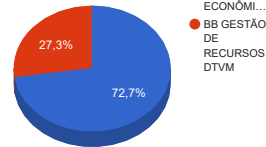
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	3,93%	4,77%	5,39%	10,63%	39,99%	0,20%	1,843%	9,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	3,93%	4,77%	5,39%	10,57%	39,87%	0,20%	1,841%	9,07%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,93%	-0,93%	0,11%	1,79%	6,16%	14,92%	0,20%	4,349%	5,15%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,05%	0,94%	1,54%	2,03%	6,03%	23,16%	0,20%	4,337%	7,58%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,43%	-1,41%	-1,06%	0,64%	3,66%	9,89%	0,20%	4,703%	4,18%
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%
IDKA IPCA 5 Anos	0,50%	3,11%	4,00%	4,91%	12,94%	33,98%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	2,33%	3,38%	4,56%	12,31%	-	0,20%	1,147%	5,60%
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%

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

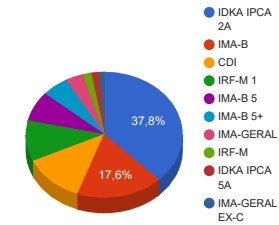
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	0,92%	1,39%	3,08%	8,07%	22,06%	0,80%	0,003%	0,11%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	101.333.540,28	72,67%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.118.119,33	27,33%



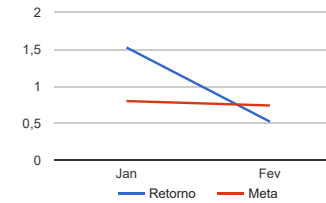
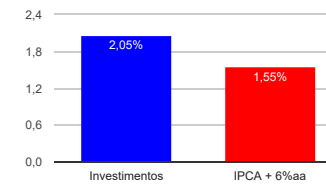
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	49.194.950,06	35,28%
IMA-B	22.895.475,60	16,42%
CDI	16.330.484,61	11,71%
IRF-M 1	13.699.247,25	9,82%
IMA-B 5	10.021.543,98	7,19%
IMA-B 5+	7.139.776,76	5,12%
IMA-GERAL	4.823.594,52	3,46%
IRF-M	2.307.191,12	1,65%
IDKA IPCA 5A	2.025.571,48	1,45%
IMA-GERAL EX-C	1.560.371,99	1,12%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	134.674.306,49	1.650.000,00	1.591.908,75	136.788.194,08	2.055.796,34	1,53%	0,80%	190,38%	0,74%
Fevereiro	136.788.194,08	3.825.353,65	1.884.524,83	139.451.659,61	722.636,71	0,52%	0,74%	70,54%	1,37%
Acumulado no ano					2.778.433,05	2,05%	1,55%	132,92%	

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(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.282.020,62	0,00	0,00	2.307.191,12	25.170,50	1,10%	0,81%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.548.638,00	0,00	0,00	1.560.371,99	11.733,99	0,76%	0,87%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.585.762,88	0,00	0,00	4.619.054,16	33.291,28	0,73%	0,80%	0,73%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	203.081,07	0,00	0,00	204.540,36	1.459,29	0,72%	0,80%	0,72%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.522.569,55	0,00	142.157,34	5.416.105,96	35.693,75	0,65%	4,35%	-1,93%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.333.105,00	0,00	36.214,42	1.305.342,00	8.451,42	0,63%	4,80%	-2,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.871.613,32	0,00	0,00	31.046.469,78	174.856,46	0,57%	0,65%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.422.433,15	0,00	0,00	14.503.268,38	80.835,23	0,56%	0,66%	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.142.736,09	0,00	0,00	5.170.698,70	27.962,61	0,54%	2,74%	0,54%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.164.537,44	0,00	0,00	9.214.165,35	49.627,91	0,54%	1,84%	0,54%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.958.558,71	0,00	0,00	1.969.078,06	10.519,35	0,54%	2,73%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.547.434,50	0,00	0,00	12.614.410,12	66.975,62	0,53%	0,07%	0,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.245.980,80	0,00	0,00	7.284.350,58	38.369,78	0,53%	1,84%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.079.174,82	0,00	0,00	1.084.837,13	5.662,31	0,52%	0,07%	0,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.629.164,59	0,00	0,00	1.637.638,21	8.473,62	0,52%	0,78%	0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.387.138,34	565.337,21	0,00	2.967.799,81	15.324,26	0,52%	0,78%	0,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.069.453,58	0,00	54.581,29	2.025.571,48	10.699,19	0,52%	1,15%	0,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.530.746,73	0,00	164.145,17	6.396.959,67	30.358,11	0,46%	4,34%	-2,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.727.684,84	160.016,44	0,00	1.896.060,12	8.358,84	0,44%	0,01%	0,47%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	12.443.483,89	3.100.000,00	1.159.171,18	14.434.424,49	50.111,78	0,32%	0,00%	0,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	520.340,37	0,00	14.539,98	507.040,81	1.240,42	0,24%	0,36%	0,24%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.351.103,43	0,00	222.820,28	8.148.110,24	19.827,09	0,24%	4,70%	-2,43%

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(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.221.432,36	0,00	90.895,17	3.138.171,09	7.633,90	0,24%	0,36%	0,24%
Total Renda Fixa					722.636,71	0,52%	1,37%	