

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
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.341.163,00	1,62%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	75.354,68	0,09%	800	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	702.126,17	0,85%	538	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.448.965,30	1,75%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	223.216,80	0,27%	751	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.183.625,45	1,43%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.374.219,91	10,11%	369	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.478.519,03	7,82%	1.463	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.129.017,25	1,36%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.679.252,73	9,27%	799	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.246.968,49	8,75%	762	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	763.525,79	0,92%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	98.365,87	0,12%	1.249	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	D+1	Não há	250.761,64	0,30%	71	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.049.467,69	1,27%	276	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.434.216,93	1,73%	405	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	3.173.154,32	3,83%	203	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.081.400,31	17,00%	387	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.011.870,86	1,22%	826	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	905.383,22	1,09%	782	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.160.183,33	2,61%	57	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.100.988,00	1,33%	74	0,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

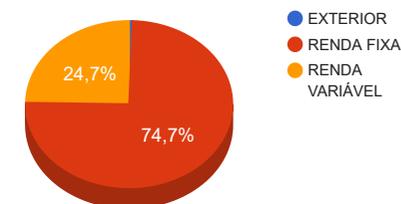
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.527.213,71	1,84%	6	2,39%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.365.905,74	1,65%	66	0,48%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	688.524,72	0,83%	48	0,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRAPRESA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.692.054,96	3,25%	1.917	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	Não há	1.000.706,38	1,21%	55	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.016.354,13	3,64%	770	4,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.355.381,04	1,64%	151	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.452.620,73	2,96%	3.449	4,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.174.233,61	2,62%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.856.729,69	3,45%	224	0,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.082.807,09	1,31%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	272.793,61	0,33%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	448.600,51	0,54%	69	0,11%	Artigo 9º - A, Inciso III
TOTAL -			82.845.672,69				

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

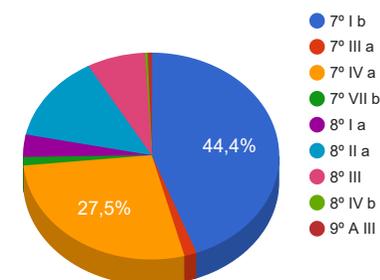
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	36.744.320,47	44,35%	15,00%	27,00%	90,00%	37.816.784,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.300.229,33	1,57%	0,00%	10,00%	60,00%	48.407.174,28
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	22.766.208,97	27,48%	10,00%	30,00%	40,00%	10.372.060,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.142.283,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.100.988,00	1,33%	0,00%	2,00%	5,00%	3.041.295,63
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.893.119,45	3,49%	0,00%	5,00%	10,00%	5.391.447,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	11.205.641,96	13,53%	0,00%	10,00%	20,00%	5.363.492,58
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.113.770,39	7,38%	0,00%	10,00%	10,00%	2.170.796,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.142.283,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	272.793,61	0,33%	0,00%	2,50%	5,00%	3.869.490,02
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	448.600,51	0,54%	0,00%	0,00%	0,00%	-448.600,51
Total Carteira		82.845.672,69					

EXTERIOR	448.600,51	0,54%
RENDA FIXA	61.911.746,77	74,73%
RENDA VARIÁVEL	20.485.325,41	24,73%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	36.744.320,47	44,35%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.300.229,33	1,57%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.766.208,97	27,48%	10,00%	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 "	1.100.988,00	1,33%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.893.119,45	3,49%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	11.205.641,96	13,53%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.113.770,39	7,38%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	272.793,61	0,33%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	448.600,51	0,54%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	82.845.672,69	100,00%	25,00	280,00

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	62.499.426,66	75,44%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.639.963,44	10,43%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	6.055.749,07	7,31%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	4.126.271,89	4,98%	0,00%
VINCI PARTNERS	1.000.706,38	1,21%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	272.793,61	0,33%	0,02%
SICREDI	250.761,64	0,30%	0,00%

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
IPCA + 6,00% ao ano	0,90%	1,73%	2,36%	4,56%	10,12%	19,97%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	2,32%	3,88%	9,04%	18,38%	29,05%	0,20%	0,983%	4,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	2,44%	4,12%	9,63%	10,68%	24,49%	0,15%	1,078%	4,50%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,17%	-1,35%	-1,00%	1,26%	3,88%	7,04%	0,20%	4,901%	4,15%

IMA-B	0,55%	4,94%	6,67%	15,14%	14,11%	26,50%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,55%	4,89%	6,60%	15,01%	14,00%	25,88%	0,20%	2,389%	5,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	4,93%	6,64%	15,10%	13,92%	26,03%	0,20%	2,409%	5,55%
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%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,86%	0,51%	2,32%	8,46%	5,65%	12,02%	0,20%	4,456%	6,74%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,16%	-1,13%	-0,21%	2,85%	3,16%	9,51%	0,20%	4,650%	4,52%

IMA-B 5	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-	-
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,49%	1,03%	1,52%	3,03%	6,26%	15,76%	0,20%	0,003%	0,03%

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,48%	1,02%	1,49%	3,03%	6,31%	15,93%	0,20%	0,007%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	1,01%	1,50%	2,99%	6,23%	15,70%	0,20%	0,005%	0,02%
Selic	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,95%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,48%	1,02%	1,51%	3,03%	6,28%	16,24%	0,20%	0,005%	0,01%
IRF-M 1	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,45%	1,05%	1,60%	3,70%	6,73%	17,17%	0,20%	0,114%	0,56%
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%
IPCA	0,43%	0,75%	0,90%	1,63%	3,89%	6,85%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,61%	2,08%	3,21%	7,48%	11,12%	25,60%	0,20%	0,669%	3,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,50%	3,40%	4,77%	7,64%	9,66%	20,69%	0,002	2,407%	2,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,34%	2,72%	4,26%	6,02%	8,73%	19,83%	0,40%	1,411%	1,64%
IRF-M	0,29%	1,68%	3,24%	9,41%	9,94%	24,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,28%	1,63%	3,13%	9,45%	9,71%	23,73%	0,20%	0,983%	3,52%

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
IFIX	1,03%	3,53%	5,83%	13,80%	5,33%	20,00%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	0,000%	-
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,59%	1,42%	1,85%	4,43%	7,48%	21,77%	0,60%	0,297%	2,58%
ICON	-4,30%	7,47%	7,31%	17,34%	-0,56%	24,12%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-4,87%	7,08%	6,66%	15,44%	-4,39%	19,19%	1,60%	8,738%	20,46%
IDIV	-2,03%	10,20%	10,92%	32,82%	17,00%	37,80%	-	-	-
BRAPRES DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,76%	7,52%	7,79%	26,69%	15,14%	44,87%	1,50%	9,385%	19,86%
Ibovespa	-1,86%	8,76%	6,79%	24,66%	11,99%	43,39%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,28%	0,84%	1,67%	5,12%	7,27%	-	1,60%	0,233%	2,43%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,21%	1,19%	2,60%	7,35%	-	-	1,60%	0,700%	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,81%	13,30%	14,32%	41,72%	18,53%	40,53%	2,00%	8,039%	21,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-1,49%	6,67%	10,59%	28,32%	22,46%	56,26%	2,50%	9,594%	19,30%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-1,83%	8,60%	6,70%	24,20%	11,44%	41,70%	0,50%	10,059%	21,56%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-3,16%	11,64%	10,88%	39,03%	18,35%	-	2,00%	9,325%	22,94%
SMLL	-1,82%	7,42%	9,67%	26,86%	11,74%	47,26%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-2,29%	10,72%	16,13%	34,87%	19,40%	55,54%	1,72%	6,970%	18,45%

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

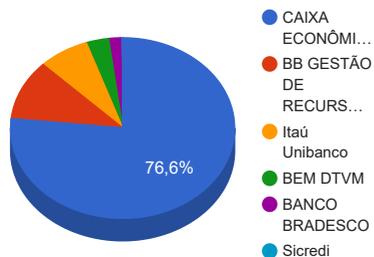
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGCT	-1,77%	8,61%	7,73%	27,92%	15,13%	46,75%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	-1,79%	8,52%	7,66%	27,64%	14,64%	45,73%	0,90%	9,768%	21,00%

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (fevereiro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	5,96%	6,73%	-1,52%	-11,92%	19,14%	47,52%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	5,80%	6,50%	-1,82%	-12,21%	17,20%	43,17%	0,70%	4,768%	18,28%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	63.500.133,04	76,65%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.912.757,05	10,76%
Itaú Unibanco	6.055.749,07	7,31%
BEM DTVM	2.692.054,96	3,25%
BANCO BRADESCO	1.434.216,93	1,73%
Sicredi	250.761,64	0,30%



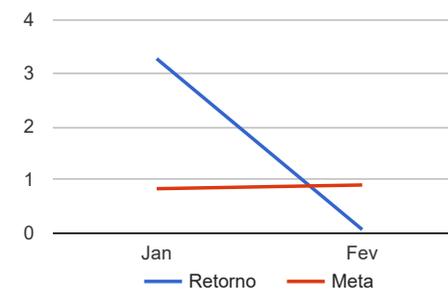
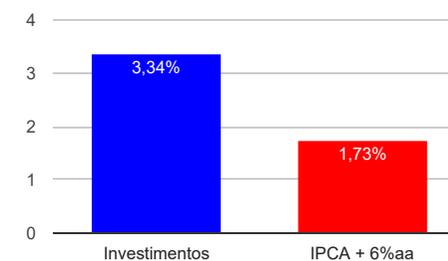
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	17.254.554,63	20,83%
AÇÕES - SETORIAIS	10.688.949,91	12,90%
IMA-B 5	8.375.985,74	10,11%
IRF-M	8.374.219,91	10,11%
IDKA IPCA 2A	7.754.607,41	9,36%
IRF-M 1	6.827.646,54	8,24%
MULTIMERCADO	6.113.770,39	7,38%
CDI	5.511.654,34	6,65%
IMA-B	5.370.927,20	6,48%
AÇÕES - LIVRES	2.043.905,76	2,47%
AÇÕES - INDEXADO	1.365.905,74	1,65%
IMA-B 5+	1.341.163,00	1,62%
CRÉDITO PRIVADO	1.100.988,00	1,33%
BDR NÍVEL I	448.600,51	0,54%
FUNDO IMOBILIÁRIO	272.793,61	0,33%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	80.445.558,00	1.132.453,93	2.697.847,21	81.511.600,07	2.631.435,35	3,27%	0,83%	393,34%	2,09%
Fevereiro	81.511.600,07	7.523.087,89	6.241.455,76	82.845.672,69	52.440,49	0,06%	0,90%	7,07%	2,57%
Acumulado no ano					2.683.875,84	3,34%	1,73%	192,35%	

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(%)
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.370.871,00	0,00	40.067,94	1.341.163,00	10.359,94	0,76%	4,90%	-2,17%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.094.278,05	0,00	0,00	1.100.988,00	6.709,95	0,61%	0,67%	0,61%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	74.900,24	0,00	0,00	75.354,68	454,44	0,61%	0,64%	0,61%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.043.760,28	0,00	0,00	1.049.467,69	5.707,41	0,55%	2,39%	0,55%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.153.885,71	0,00	31.001,97	1.129.017,25	6.133,51	0,53%	4,65%	-2,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.209.201,05	0,00	0,00	7.246.968,49	37.767,44	0,52%	0,79%	0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	222.067,51	0,00	0,00	223.216,80	1.149,29	0,52%	2,41%	0,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.441.960,01	1.197.944,78	0,00	7.679.252,73	39.347,94	0,52%	0,63%	0,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	698.657,82	0,00	0,00	702.126,17	3.468,35	0,50%	2,43%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.479.788,56	0,00	38.118,65	1.448.965,30	7.295,39	0,49%	0,98%	0,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	13.359.609,74	652.851,57	0,00	14.081.400,31	68.939,00	0,49%	2,41%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	779.913,55	0,00	20.218,96	763.525,79	3.831,20	0,49%	1,08%	0,49%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.149.669,85	0,00	0,00	2.160.183,33	10.513,48	0,49%	0,00%	0,49%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.007.006,21	0,00	0,00	1.011.870,86	4.864,65	0,48%	0,00%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	97.936,10	0,00	0,00	98.365,87	429,77	0,44%	0,08%	0,44%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	231.852,90	17.860,74	0,00	250.761,64	1.048,00	0,42%	0,11%	0,45%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.158.484,25	270.000,00	0,00	1.434.216,93	5.732,68	0,40%	0,01%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.206.116,95	0,00	26.781,66	1.183.625,45	4.290,16	0,36%	4,46%	-1,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.387.628,23	2.898.452,27	2.840.266,58	6.478.519,03	32.705,11	0,35%	0,08%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.154.283,32	7.640,92	2.267.450,00	905.383,22	10.908,98	0,35%	0,01%	0,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	3.012.821,34	150.000,00	0,00	3.173.154,32	10.332,98	0,33%	1,41%	0,34%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.351.222,29	0,00	0,00	8.374.219,91	22.997,62	0,28%	0,98%	0,28%
Total Renda Fixa					294.987,29	0,48%	1,34%	

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(%)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	266.556,26	0,00	2.550,00	272.793,61	8.787,35	3,30%	0,00%	0,00%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	520.301,61	2.328.337,61	0,00	2.856.729,69	8.090,47	0,28%	0,30%	0,59%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.168.200,05	0,00	0,00	2.174.233,61	6.033,56	0,28%	0,23%	0,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.080.574,01	0,00	0,00	1.082.807,09	2.233,08	0,21%	0,70%	0,21%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.980.456,42	0,00	270.000,00	2.692.054,96	-18.401,46	-0,62%	9,38%	-0,76%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.340.307,88	0,00	300.000,00	3.016.354,13	-23.953,75	-0,72%	8,04%	-0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.375.899,23	0,00	0,00	1.355.381,04	-20.518,19	-1,49%	9,59%	-1,49%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.705.045,88	0,00	150.000,00	1.527.213,71	-27.832,17	-1,63%	9,77%	-1,79%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.391.382,80	0,00	0,00	1.365.905,74	-25.477,06	-1,83%	10,06%	-1,83%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1.024.189,99	0,00	0,00	1.000.706,38	-23.483,61	-2,29%	6,97%	-2,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	710.978,28	0,00	0,00	688.524,72	-22.453,56	-3,16%	9,33%	-3,16%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.837.777,32	0,00	255.000,00	2.452.620,73	-130.156,59	-4,59%	8,74%	-4,87%
Total Renda Variável					-267.131,93	-1,29%	6,25%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	424.015,38	0,00	0,00	448.600,51	24.585,13	5,80%	4,77%	5,80%
Total Exterior					24.585,13	5,80%	4,77%	