

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	769.602,43	0,93%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	98.797,12	0,12%	1.248	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.354.479,00	1,64%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	75.844,91	0,09%	819	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	706.047,67	0,86%	547	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.460.029,24	1,77%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	224.467,03	0,27%	777	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.194.434,23	1,45%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.420.235,94	10,21%	368	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.396.653,88	6,55%	1.454	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.135.657,26	1,38%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.084.869,80	9,81%	830	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.302.368,22	8,86%	782	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	D+1	Não há	268.755,66	0,33%	76	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.055.342,90	1,28%	280	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.440.921,46	1,75%	399	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	3.185.605,35	3,86%	213	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.158.084,71	17,17%	416	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.016.589,91	1,23%	832	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	919.369,45	1,12%	775	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.170.428,05	2,63%	56	0,84%	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	1.109.807,40	1,35%	73	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

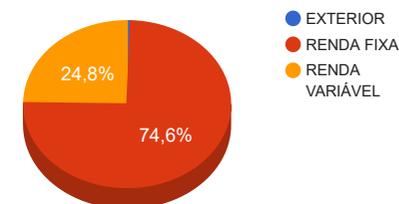
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.363.203,44	1,65%	72	0,46%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.524.158,86	1,85%	6	2,43%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.429.579,66	2,95%	3.479	3,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	696.381,47	0,84%	63	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.679.143,03	3,25%	2.031	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	Não há	983.034,26	1,19%	55	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.995.638,16	3,63%	855	4,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.342.904,71	1,63%	149	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.181.276,76	2,65%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.869.178,75	3,48%	230	0,52%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.086.859,91	1,32%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	274.191,04	0,33%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	476.042,77	0,58%	68	0,11%	Artigo 9º - A, Inciso III
TOTAL -			82.449.984,44				

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

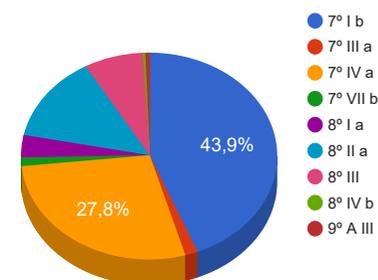
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	36.223.486,73	43,93%	15,00%	27,00%	90,00%	37.981.499,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.324.098,56	1,61%	0,00%	10,00%	60,00%	48.145.892,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	22.890.998,93	27,76%	10,00%	30,00%	40,00%	10.088.994,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.122.499,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.109.807,40	1,35%	0,00%	2,00%	5,00%	3.012.691,82
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.887.362,30	3,50%	0,00%	5,00%	10,00%	5.357.636,14
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	11.126.681,29	13,50%	0,00%	10,00%	20,00%	5.363.315,60
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.137.315,42	7,44%	0,00%	10,00%	10,00%	2.107.683,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.122.499,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	274.191,04	0,33%	0,00%	2,50%	5,00%	3.848.308,18
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	476.042,77	0,58%	0,00%	0,00%	0,00%	-476.042,77
Total Carteira		82.449.984,44					

EXTERIOR	476.042,77	0,58%
RENDA FIXA	61.548.391,62	74,65%
RENDA VARIÁVEL	20.425.550,05	24,77%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 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 "	36.223.486,73	43,93%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.324.098,56	1,61%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.890.998,93	27,76%	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 "	1.109.807,40	1,35%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.887.362,30	3,50%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	11.126.681,29	13,50%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.137.315,42	7,44%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	274.191,04	0,33%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	476.042,77	0,58%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	82.449.984,44	100,00%	25,00	280,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 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	62.046.211,63	75,25%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.705.058,44	10,56%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	6.052.668,92	7,34%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	4.120.064,49	5,00%	0,00%
VINCI PARTNERS	983.034,26	1,19%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	274.191,04	0,33%	0,02%
SICREDI	268.755,66	0,33%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,19%	2,95%	2,95%	4,84%	10,80%	20,46%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	-0,37%	-0,37%	1,70%	4,15%	7,20%	0,20%	0,141%	4,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	3,26%	3,26%	9,58%	9,27%	23,38%	0,15%	1,746%	4,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	3,10%	3,10%	8,90%	18,43%	28,96%	0,20%	1,566%	4,69%
IMA-B 5	0,78%	2,90%	2,90%	7,68%	9,19%	22,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76%	2,85%	2,85%	7,64%	9,00%	21,82%	0,20%	1,209%	3,07%
IPCA	0,75%	1,51%	1,51%	1,90%	4,58%	7,38%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,80%	2,90%	2,90%	7,39%	10,02%	24,44%	0,20%	1,107%	3,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,54%	3,96%	3,96%	7,52%	8,97%	19,63%	0,002	4,048%	3,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,39%	3,12%	3,12%	5,99%	8,05%	18,72%	0,40%	1,888%	1,89%
IDKA IPCA 2 Anos	0,67%	2,48%	2,48%	5,97%	9,19%	22,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	2,50%	2,50%	5,99%	8,71%	21,23%	0,20%	0,932%	2,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	2,49%	2,49%	6,03%	8,65%	21,14%	0,20%	0,893%	2,35%
IRF-M	0,59%	2,28%	2,28%	8,65%	9,14%	23,19%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	2,19%	2,19%	8,77%	8,90%	22,66%	0,20%	1,671%	3,63%
IMA-B	0,58%	5,54%	5,54%	15,99%	13,71%	25,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	1,43%	1,43%	9,73%	4,33%	11,72%	0,20%	2,585%	6,86%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	-0,55%	-0,55%	2,21%	2,10%	8,38%	0,20%	0,500%	4,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	5,52%	5,52%	15,95%	13,52%	25,44%	0,20%	4,050%	5,97%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,56%	5,48%	5,48%	15,80%	13,60%	25,40%	0,20%	4,010%	5,84%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	5,46%	5,46%	15,78%	13,40%	25,24%	0,20%	4,049%	5,94%
IRF-M 1	0,47%	1,53%	1,53%	3,59%	6,68%	16,65%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,44%	1,50%	1,50%	3,55%	6,52%	16,39%	0,20%	0,130%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	1,47%	1,47%	3,51%	6,50%	16,26%	0,20%	0,094%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,46%	1,46%	3,49%	6,45%	16,15%	0,10%	0,106%	0,55%
Selic	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,35%	15,28%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	1,49%	1,49%	3,03%	6,22%	15,57%	0,20%	0,008%	0,01%
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,47%	1,51%	1,51%	3,03%	6,22%	15,09%	0,20%	0,016%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,47%	1,49%	1,49%	3,01%	6,18%	15,01%	0,20%	0,009%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	1,48%	1,48%	3,00%	6,23%	15,23%	0,20%	0,005%	0,04%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,99%	5,58%	5,58%	16,31%	5,32%	22,14%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,44%	1,86%	1,86%	3,68%	7,03%	19,01%	0,60%	0,266%	2,59%
SMLL	0,10%	7,53%	7,53%	29,53%	11,77%	49,58%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-1,77%	8,77%	8,77%	33,64%	14,64%	52,43%	1,72%	10,810%	19,17%
IDIV	-1,79%	8,23%	8,23%	30,23%	13,71%	37,90%	-	-	-
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,48%	7,00%	7,00%	21,86%	12,67%	46,70%	1,50%	11,794%	20,75%
ICON	-0,78%	6,64%	6,64%	15,84%	-0,70%	22,86%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-0,94%	6,07%	6,07%	14,33%	-4,26%	17,90%	1,60%	12,134%	21,22%
Ibovespa	-0,18%	8,56%	8,56%	20,26%	11,77%	46,83%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,14%	12,91%	12,91%	40,92%	21,13%	-	2,00%	13,024%	23,80%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,37%	1,57%	1,57%	7,03%	-	-	1,60%	0,937%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,32%	1,16%	1,16%	4,49%	5,58%	-	1,60%	0,274%	2,30%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-0,20%	8,38%	8,38%	19,87%	11,24%	45,20%	0,50%	12,548%	22,45%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,69%	12,52%	12,52%	40,95%	18,76%	40,76%	2,00%	11,994%	22,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,92%	5,69%	5,69%	28,79%	19,15%	57,15%	2,50%	13,650%	20,53%

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

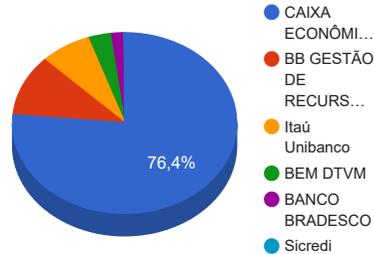
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGCT	-0,15%	8,44%	8,44%	23,55%	15,51%	49,94%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	-0,20%	8,30%	8,30%	23,26%	15,00%	48,84%	0,90%	12,270%	21,91%

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

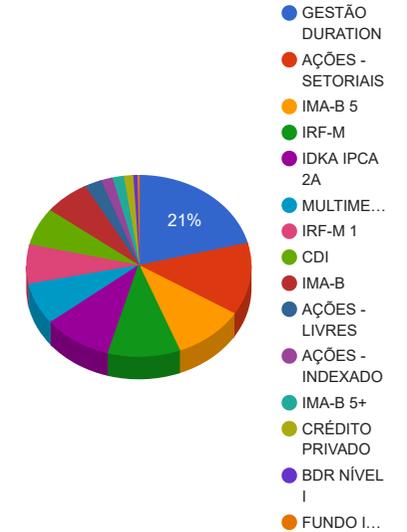
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	6,19%	13,34%	13,34%	-6,06%	29,96%	55,79%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	6,12%	13,01%	13,01%	-6,28%	27,86%	50,93%	0,70%	7,835%	18,19%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	63.029.245,89	76,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.979.249,48	10,89%
Itaú Unibanco	6.052.668,92	7,34%
BEM DTVM	2.679.143,03	3,25%
BANCO BRADESCO	1.440.921,46	1,75%
Sicredi	268.755,66	0,33%



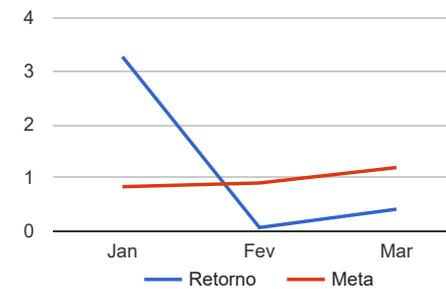
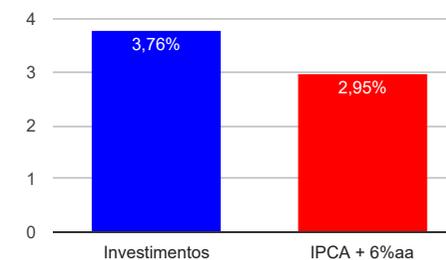
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	17.343.690,06	21,04%
AÇÕES - SETORIAIS	10.611.553,97	12,87%
IMA-B 5	8.438.025,48	10,23%
IRF-M	8.420.235,94	10,21%
IDKA IPCA 2A	8.160.714,71	9,90%
MULTIMERCADO	6.137.315,42	7,44%
IRF-M 1	5.764.206,66	6,99%
CDI	5.547.308,87	6,73%
IMA-B	5.409.923,50	6,56%
AÇÕES - LIVRES	2.039.286,18	2,47%
AÇÕES - INDEXADO	1.363.203,44	1,65%
IMA-B 5+	1.354.479,00	1,64%
CRÉDITO PRIVADO	1.109.807,40	1,35%
BDR NÍVEL I	476.042,77	0,58%
FUNDO IMOBILIÁRIO	274.191,04	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%
Março	82.845.672,69	1.690.098,38	2.423.381,46	82.449.984,44	337.594,83	0,41%	1,19%	34,14%	3,51%
Acumulado no ano					3.021.470,67	3,76%	2,95%	127,42%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de março / 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	1.341.163,00	0,00	0,00	1.354.479,00	13.316,00	0,99%	0,14%	0,99%	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.183.625,45	0,00	0,00	1.194.434,23	10.808,78	0,91%	2,58%	0,91%	
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.100.988,00	0,00	0,00	1.109.807,40	8.819,40	0,80%	1,11%	0,80%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	763.525,79	0,00	0,00	769.602,43	6.076,64	0,80%	1,75%	0,80%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.246.968,49	0,00	0,00	7.302.368,22	55.399,73	0,76%	1,21%	0,76%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.448.965,30	0,00	0,00	1.460.029,24	11.063,94	0,76%	1,57%	0,76%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	75.354,68	0,00	0,00	75.844,91	490,23	0,65%	0,89%	0,65%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.679.252,73	353.841,93	0,00	8.084.869,80	51.775,14	0,64%	0,93%	0,66%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.129.017,25	0,00	0,00	1.135.657,26	6.640,01	0,59%	0,50%	0,59%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	223.216,80	0,00	0,00	224.467,03	1.250,23	0,56%	4,05%	0,56%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.049.467,69	0,00	0,00	1.055.342,90	5.875,21	0,56%	4,01%	0,56%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	702.126,17	0,00	0,00	706.047,67	3.921,50	0,56%	4,05%	0,56%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.374.219,91	0,00	0,00	8.420.235,94	46.016,03	0,55%	1,67%	0,55%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.081.400,31	0,00	0,00	14.158.084,71	76.684,40	0,54%	4,05%	0,54%	
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.160.183,33	0,00	0,00	2.170.428,05	10.244,72	0,47%	0,02%	0,47%	
BRASECO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.434.216,93	0,00	0,00	1.440.921,46	6.704,53	0,47%	0,01%	0,47%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.011.870,86	0,00	0,00	1.016.589,91	4.719,05	0,47%	0,01%	0,47%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	905.383,22	9.783,66	0,00	919.369,45	4.202,57	0,46%	0,00%	0,46%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	98.365,87	0,00	0,00	98.797,12	431,25	0,44%	0,11%	0,44%	
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	250.761,64	16.869,93	0,00	268.755,66	1.124,09	0,42%	0,13%	0,44%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	3.173.154,32	0,00	0,00	3.185.605,35	12.451,03	0,39%	1,89%	0,39%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.478.519,03	1.309.602,86	2.421.671,46	5.396.653,88	30.203,45	0,39%	0,09%	0,44%	
Total Renda Fixa						368.217,93	0,59%	1,81%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	688.524,72	0,00	0,00	696.381,47	7.856,75	1,14%	13,02%	1,14%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	272.793,61	0,00	1.710,00	274.191,04	3.107,43	1,14%	-	0,00%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.856.729,69	0,00	0,00	2.869.178,75	12.449,06	0,44%	0,27%	0,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.082.807,09	0,00	0,00	1.086.859,91	4.052,82	0,37%	0,94%	0,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.174.233,61	0,00	0,00	2.181.276,76	7.043,15	0,32%	0,27%	0,32%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.365.905,74	0,00	0,00	1.363.203,44	-2.702,30	-0,20%	12,55%	-0,20%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.527.213,71	0,00	0,00	1.524.158,86	-3.054,85	-0,20%	12,27%	-0,20%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.692.054,96	0,00	0,00	2.679.143,03	-12.911,93	-0,48%	11,79%	-0,48%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.016.354,13	0,00	0,00	2.995.638,16	-20.715,97	-0,69%	11,99%	-0,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.355.381,04	0,00	0,00	1.342.904,71	-12.476,33	-0,92%	13,65%	-0,92%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.452.620,73	0,00	0,00	2.429.579,66	-23.041,07	-0,94%	12,13%	-0,94%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1.000.706,38	0,00	0,00	983.034,26	-17.672,12	-1,77%	10,81%	-1,77%
Total Renda Variável					-58.065,36	-0,28%	8,60%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de março / 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	448.600,51	0,00	0,00	476.042,77	27.442,26	6,12%	7,83%	6,12%
				Total Exterior	27.442,26	6,12%	7,83%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	12.985.509,00	652.851,57	0,00	14.158.084,71	519.724,14	3,95%	3,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.100.358,95	0,00	0,00	7.302.368,22	202.009,27	2,85%	2,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.239.935,42	0,00	0,00	8.420.235,94	180.300,52	2,19%	2,19%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.272.791,65	1.640.846,45	0,00	8.084.869,80	171.231,70	2,44%	2,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.001.592,27	5.246.064,48	7.957.685,25	5.396.653,88	106.682,38	1,23%	1,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.942.979,66	150.000,00	0,00	3.185.605,35	92.625,69	3,11%	3,12%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.000.535,55	0,00	0,00	1.055.342,90	54.807,35	5,48%	5,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.453.493,86	0,00	38.118,65	1.460.029,24	44.654,03	3,09%	3,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.177.617,81	0,00	26.781,66	1.194.434,23	43.598,08	3,72%	1,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	669.494,38	0,00	0,00	706.047,67	36.553,29	5,46%	5,46%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.359.527,00	0,00	40.067,94	1.354.479,00	35.019,94	2,61%	-0,37%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.138.084,55	0,00	0,00	2.170.428,05	32.343,50	1,51%	1,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.132.284,38	22.809,42	2.267.450,00	919.369,45	31.725,65	1,34%	1,48%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.078.540,08	0,00	0,00	1.109.807,40	31.267,32	2,90%	2,90%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.141.900,26	0,00	31.001,97	1.135.657,26	24.758,97	2,18%	-0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	765.092,71	0,00	20.218,96	769.602,43	24.728,68	3,25%	3,26%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.152.335,93	270.000,00	0,00	1.440.921,46	18.585,53	1,41%	1,49%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.001.707,69	0,00	0,00	1.016.589,91	14.882,22	1,49%	1,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	212.720,84	0,00	0,00	224.467,03	11.746,19	5,52%	5,52%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	230.470,11	34.730,67	0,00	268.755,66	3.554,88	1,45%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	74.000,89	0,00	0,00	75.844,91	1.844,02	2,49%	2,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	97.375,87	0,00	0,00	98.797,12	1.421,25	1,46%	1,46%
Total Renda Fixa					1.684.064,60	2,73%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.924.369,01	0,00	300.000,00	2.995.638,16	371.269,15	12,63%	12,52%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.751.001,07	0,00	270.000,00	2.679.143,03	198.141,96	7,16%	7,00%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.521.267,58	0,00	255.000,00	2.429.579,66	163.312,08	6,38%	6,07%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.543.048,80	0,00	150.000,00	1.524.158,86	131.110,06	8,48%	8,30%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.257.770,44	0,00	0,00	1.363.203,44	105.433,00	8,38%	8,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	616.755,95	0,00	0,00	696.381,47	79.625,52	12,91%	12,91%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	903.790,11	0,00	0,00	983.034,26	79.244,15	8,77%	8,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.270.594,85	0,00	0,00	1.342.904,71	72.309,86	5,69%	5,69%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.156.192,90	0,00	0,00	2.181.276,76	25.083,86	1,16%	1,16%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	516.087,59	2.328.337,61	0,00	2.869.178,75	24.753,55	1,54%	1,86%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.070.023,47	0,00	0,00	1.086.859,91	16.836,44	1,57%	1,57%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	265.074,48	0,00	6.360,00	274.191,04	15.476,56	5,88%	0,00%
Total Renda Variável					1.282.596,19	7,44%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	421.232,89	0,00	0,00	476.042,77	54.809,88	13,01%	13,01%
				Total Exterior	54.809,88	13,01%	