

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 2019)

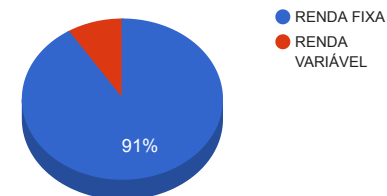
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.312.088,04	7,39%	420	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.396.259,93	14,04%	1.466	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.470.927,60	7,89%	738	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.058.628,27	3,38%	1.263	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.349.853,22	29,87%	780	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.737.369,24	5,55%	793	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.201.327,23	7,03%	823	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.946.494,29	15,80%	30	6,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	467.304,95	1,49%	222	0,09%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.347.313,76	4,30%	2.061	0,26%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.018.432,46	3,25%	78	0,67%	Artigo 8º, Inciso III
		Total	31.305.998,99				

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

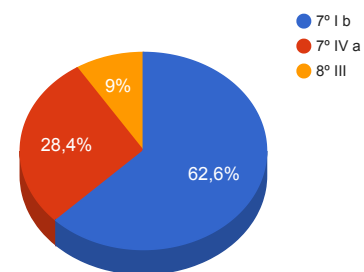
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	19.587.757,06	62,57%	15,00%	25,00%	70,00%	2.326.442,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	18.783.599,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.885.190,76	28,38%	10,00%	30,00%	40,00%	3.637.208,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.565.299,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	3,00%	10,00%	20,00%	6.261.199,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.833.051,17	9,05%	7,00%	10,00%	10,00%	297.548,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.565.299,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.565.299,95
Total Carteira		31.305.998,99					

RENDA FIXA	28.472.947,82	90,95%
RENDA VARIÁVEL	2.833.051,17	9,05%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	19.587.757,06	62,57%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	8.885.190,76	28,38%	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 "	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 II, Alínea " a "	0,00	0,00%	3,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.833.051,17	9,05%	7,00%	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	31.305.998,99	100,00%	40,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.925.243,72	47,68%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.415.828,52	33,27%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	5.964.926,75	19,05%	0,86%

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

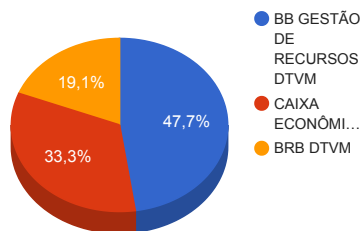
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	6,61%	6,61%	10,27%	20,14%	17,23%	35,69%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,62%	1,62%	2,94%	6,99%	8,43%	27,03%	0,50%	0,572%	3,65%
IMA-B 5	1,54%	1,54%	3,07%	6,93%	10,09%	24,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,53%	1,53%	3,07%	6,88%	9,91%	23,73%	0,20%	0,735%	3,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,52%	1,52%	3,02%	6,83%	9,88%	23,73%	0,20%	0,732%	3,05%
IDKA IPCA 2 Anos	1,26%	1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	1,22%	2,56%	5,85%	9,50%	22,93%	0,20%	0,607%	2,36%
IRF-M 1	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	0,58%	1,64%	3,60%	6,75%	17,55%	0,10%	0,109%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,65%	3,62%	6,80%	17,67%	0,20%	0,099%	0,55%
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	0,53%	1,49%	3,10%	6,29%	16,40%	0,20%	0,003%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	0,53%	1,50%	3,07%	6,19%	16,16%	0,20%	0,002%	0,02%

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

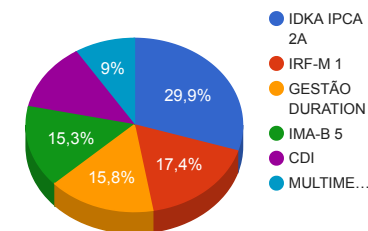
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,82%	0,82%	1,88%	3,28%	7,35%	20,99%	0,60%	0,364%	2,59%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,73%	0,73%	1,65%	3,35%	6,92%	18,91%	1,00%	0,334%	0,56%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,48%	0,48%	1,34%	2,89%	5,41%	15,23%	0,70%	0,096%	0,34%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.925.243,72	47,68%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.415.828,52	33,27%
BRB DTVM	5.964.926,75	19,05%



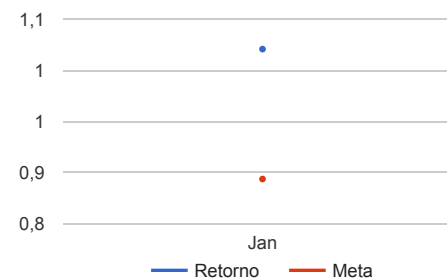
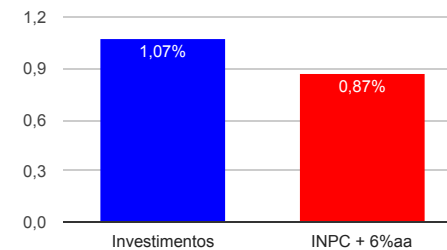
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	9.349.853,22	29,87%
IRF-M 1	5.454.888,20	17,42%
GESTÃO DURATION	4.946.494,29	15,80%
IMA-B 5	4.783.015,64	15,28%
CDI	3.938.696,47	12,58%
MULTIMERCADO	2.833.051,17	9,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	30.906.843,36	0,00	140.214,45	31.098.343,84	331.714,93	1,07%	0,87%	123,11%	0,42%
Acumulado no ano					331.714,93	1,07%	0,87%	123,11%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	4.867.673,36	0,00	0,00	4.946.494,29	78.820,93	1,62%	0,57%	1,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.433.622,36	0,00	0,00	2.470.927,60	37.305,24	1,53%	0,74%	1,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.277.472,68	0,00	0,00	2.312.088,04	34.615,36	1,52%	0,73%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.237.586,58	0,00	0,00	9.349.853,22	112.266,64	1,22%	0,61%	1,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.371.434,30	0,00	0,00	4.396.259,93	24.825,63	0,57%	0,10%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.213.839,85	0,00	162.034,83	1.058.628,27	6.823,25	0,56%	0,11%	0,58%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.728.205,38	0,00	0,00	1.737.369,24	9.163,86	0,53%	0,00%	0,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.189.744,59	0,00	0,00	2.201.327,23	11.582,64	0,53%	0,00%	0,53%
Total Renda Fixa					315.403,55	1,11%	0,44%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	463.520,15	0,00	0,00	467.304,95	3.784,80	0,82%	0,36%	0,82%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.011.050,57	0,00	0,00	1.018.432,46	7.381,89	0,73%	0,33%	0,73%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.340.875,11	0,00	0,00	1.347.313,76	6.438,65	0,48%	0,10%	0,48%
Total Renda Variável					17.605,34	0,63%	0,23%	