

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

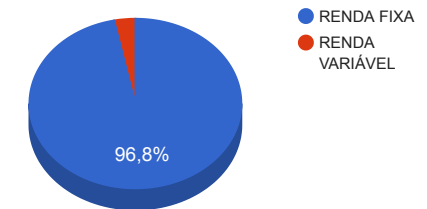
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	467.713,00	15,49%	438	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	343.673,72	11,38%	58	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	710.880,30	23,54%	58	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	475.654,91	15,75%	1.463	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	431.872,75	14,30%	126	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	131.058,71	4,34%	203	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	361.861,82	11,98%	86	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	65.527,10	2,17%	151	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	31.210,26	1,03%	1.474	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>3.019.452,57</b>				

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

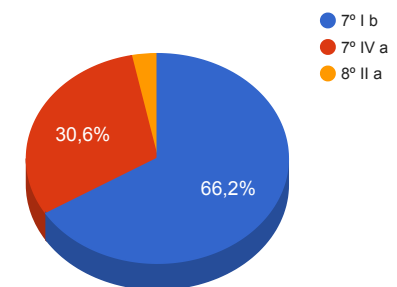
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.997.921,93	66,17%	0,00%	25,00%	100,00%	1.021.530,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	1.811.671,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	924.793,28	30,63%	0,00%	30,00%	40,00%	282.987,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	150.972,63
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	96.737,36	3,20%	0,00%	10,00%	20,00%	507.153,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	301.945,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	150.972,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	150.972,63
<b>Total Carteira</b>		<b>3.019.452,57</b>					

RENDA FIXA	2.922.715,21	96,80%
RENDA VARIÁVEL	96.737,36	3,20%

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 "	1.997.921,93	66,17%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	924.793,28	30,63%	0,00%	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 "	96.737,36	3,20%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.019.452,57</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>270,00</b>

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
ITAÚ UNIBANCO	1.683.012,58	55,74%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	506.865,17	16,79%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	467.713,00	15,49%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	361.861,82	11,98%	0,00%

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

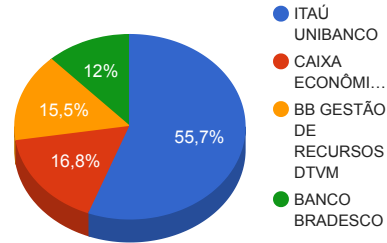
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,43%	0,75%	0,90%	1,63%	3,89%	6,85%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,34%	2,72%	4,26%	6,02%	8,73%	19,83%	0,40%	1,411%	1,64%

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

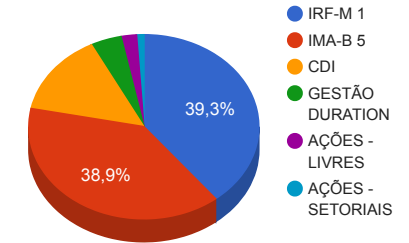
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	-2,03%	10,20%	10,92%	32,82%	17,00%	37,80%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,12%	9,82%	11,59%	31,48%	13,69%	36,42%	1,50%	6,195%	16,74%
Ibovespa	-1,86%	8,76%	6,79%	24,66%	11,99%	43,39%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-1,49%	6,67%	10,59%	28,32%	22,46%	56,26%	2,50%	9,594%	19,30%

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

Administrador	Valor	%
ITAÚ UNIBANCO	1.683.012,58	55,74%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	506.865,17	16,79%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	467.713,00	15,49%
BANCO BRADESCO	361.861,82	11,98%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	1.186.535,21	39,30%
IMA-B 5	1.173.248,54	38,86%
CDI	431.872,75	14,30%
GESTÃO DURATION	131.058,71	4,34%
AÇÕES - LIVRES	65.527,10	2,17%
AÇÕES - SETORIAIS	31.210,26	1,03%

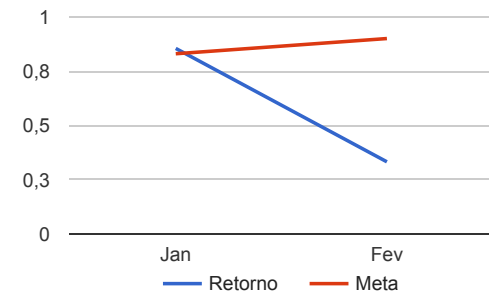
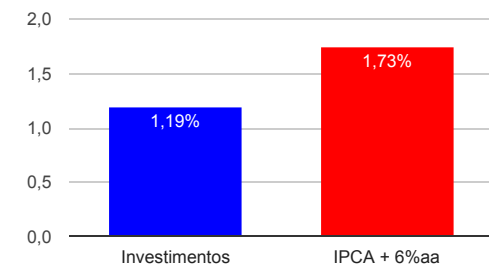




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	444.663,75	1.989.972,50	400.000,00	2.052.022,36	17.386,11	0,85%	0,83%	102,75%	0,43%
Fevereiro	2.052.022,36	1.689.076,59	731.661,51	3.019.452,57	10.015,13	0,33%	0,90%	37,16%	0,69%
Acumulado no ano					27.401,24	1,19%	1,73%	68,61%	

**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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	429.786,99	0,00	0,00	431.872,75	2.085,76	0,49%	0,01%	0,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	233.329,48	126.948,57	0,00	361.861,82	1.583,77	0,44%	0,87%	0,49%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.055.240,71	350.000,00	700.000,00	710.880,30	5.639,59	0,40%	0,09%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	174.731,44	331.661,51	31.661,51	475.654,91	923,47	0,18%	0,08%	0,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	43.168,51	300.000,00	0,00	343.673,72	505,21	0,15%	0,79%	0,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	30.868,45	100.000,00	0,00	131.058,71	190,26	0,15%	1,41%	0,34%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.377,71	448.805,00	0,00	467.713,00	530,29	0,11%	0,80%	0,52%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>11.458,35</b>	<b>0,39%</b>	<b>0,43%</b>	

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(%)
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	31.661,51	0,00	31.210,26	-451,25	-1,43%	6,19%	-3,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	66.519,07	0,00	0,00	65.527,10	-991,97	-1,49%	9,59%	-1,49%
Total Renda Variável					-1.443,22	-1,47%	8,50%	