

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

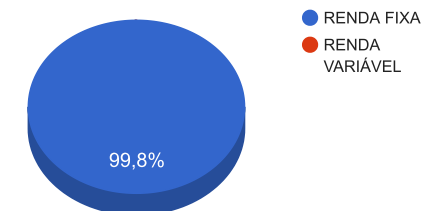
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.064.792,90	9,14%	1.454	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.082.206,37	0,82%	119	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.537.808,81	8,74%	194	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	5.201.776,15	3,94%	245	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.573.082,81	10,28%	1.248	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	8.615.338,49	6,53%	107	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.448.569,03	11,70%	104	2,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.455.416,60	4,13%	777	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.901.418,75	5,23%	819	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.805.083,70	2,88%	830	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	7.490.790,95	5,67%	442	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	11.832.225,92	8,96%	280	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	12.413.781,38	9,40%	775	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	6.327.466,98	4,79%	416	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.959.450,26	4,51%	420	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	745.191,95	0,56%	705	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.342.329,02	2,53%	219	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	100.466,73	0,08%	4.456	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	100.175,67	0,08%	3.732	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
<b>TOTAL -</b>			<b>131.997.372,47</b>				

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

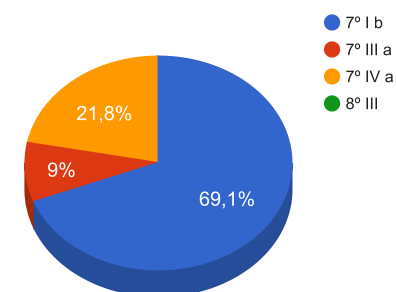
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	91.176.284,56	69,07%	15,00%	25,00%	70,00%	1.221.876,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	11.832.225,92	8,96%	5,00%	10,00%	60,00%	67.366.197,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.788.219,59	21,81%	10,00%	30,00%	40,00%	24.010.729,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.599.868,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	26.399.474,49
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	200.642,40	0,15%	7,00%	10,00%	10,00%	12.999.094,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.599.868,62
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.599.868,62
<b>Total Carteira</b>		<b>131.997.372,47</b>					

RENDA FIXA	131.796.730,07	99,85%
RENDA VARIÁVEL	200.642,40	0,15%

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 " b "	91.176.284,56	69,07%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	11.832.225,92	8,96%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	28.788.219,59	21,81%	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%	2,00%	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%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	200.642,40	0,15%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>131.997.372,47</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00</b>	<b>240,00</b>

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	66.199.146,41	50,15%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	65.798.226,06	49,85%	0,01%

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%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	2,19%	2,19%	5,02%	8,67%	19,84%	0,15%	0,498%	1,44%
IPCA	0,75%	1,51%	1,51%	1,90%	4,58%	7,38%	-	-	-
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%
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%
IMA-B	0,58%	5,54%	5,54%	15,99%	13,71%	25,92%	-	-	-
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 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	5,46%	5,46%	15,80%	13,46%	25,49%	0,30%	4,042%	5,92%
IMA Geral	0,56%	2,98%	2,98%	8,61%	9,51%	21,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	2,84%	2,84%	8,52%	9,07%	20,58%	0,20%	1,689%	2,92%
IMA Geral ex-C	0,54%	2,92%	2,92%	8,54%	9,29%	21,13%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,86%	2,86%	8,46%	9,05%	20,53%	0,20%	1,694%	2,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,94%	2,94%	8,60%	9,29%	20,53%	0,30%	1,947%	2,99%

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
IRF-M 1	0,47%	1,53%	1,53%	3,59%	6,68%	16,65%	-	-	-
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%
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	1,46%	1,46%	2,99%	6,09%	14,86%	0,20%	0,028%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	1,25%	1,25%	2,53%	5,21%	12,87%	1,00%	0,003%	0,01%
IMA-B 5+	0,43%	7,66%	7,66%	23,23%	17,28%	29,29%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	7,52%	7,52%	22,95%	16,98%	28,38%	0,20%	6,231%	8,71%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '900000' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade\_rv.asp, line 51