

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018



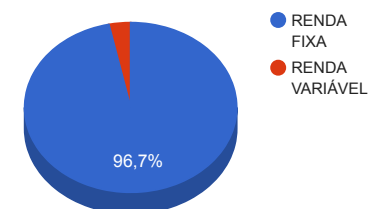
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			239.648,09	0,07%			Artigo 20
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	20.963.447,54	6,11%	223	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.842.052,03	6,08%	716	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.799.543,80	16,85%	632	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	11.307.027,48	3,30%	1.225	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	6.181.513,20	1,80%	167	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	25.549.541,60	7,45%	745	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.295.283,33	2,42%	213	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	5.072.724,45	1,48%	192	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.933.218,91	3,77%	116	2,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.727.808,71	9,54%	1.417	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	30.523.832,65	8,90%	321	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	37.592.177,71	10,96%	733	0,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	52.888.138,25	15,42%	144	5,09%	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	8.769.078,79	2,56%	60	2,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.157.317,21	0,34%	102	0,49%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.152.433,83	0,63%	3.040	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	43832	5.069.025,00	1,48%	729	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	2.921.838,23	0,85%		0,12%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
			TOTAL -	342.985.650,81			

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2018)

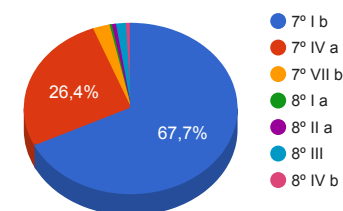
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	232.195.993,70	67,70%	15,00%	25,00%	70,00%	7.893.961,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	205.791.390,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	90.480.315,96	26,38%	5,00%	10,00%	30,00%	12.415.379,28
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	51.447.847,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	17.149.282,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	8.769.078,79	2,56%	2,00%	5,00%	5,00%	8.380.203,75
Total Renda Fixa	100,00%	331.445.388,45	96,64%	36,00	70,00	190,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	1.157.317,21	0,34%	2,00%	5,00%	10,00%	33.141.247,87
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.152.433,83	0,63%	2,00%	5,00%	10,00%	32.146.131,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.069.025,00	1,48%	7,00%	10,00%	10,00%	29.229.540,08
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	17.149.282,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.921.838,23	0,85%	2,00%	5,00%	5,00%	14.227.444,31
Total Renda Variável	30,00%	11.300.614,27	3,29%	15,00	30,00	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	232.195.993,70	67,70%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	90.480.315,96	26,38%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	8.769.078,79	2,56%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	331.445.388,45	96,64%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	1.157.317,21	0,34%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.152.433,83	0,63%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.069.025,00	1,48%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.921.838,23	0,85%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	11.300.614,27	3,29%	15,00	40,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 2018)

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	292.250.850,62	85,21%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.573.313,87	13,87%	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.921.838,23	0,85%	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,31%	2,88%	4,38%	6,02%	14,22%	47,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,41%	3,09%	4,52%	5,97%	13,86%	46,86%	0,20%	1,148%	5,87%

IRF-M	1,10%	2,42%	3,69%	5,42%	13,07%	39,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	2,56%	3,77%	5,36%	12,78%	39,17%	0,20%	0,838%	4,51%

IPCA + 6,00% ao ano	0,74%	1,55%	2,47%	4,82%	8,94%	20,97%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	1,70%	2,41%	4,65%	9,01%	21,48%	0,20%	0,154%	0,35%

IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	1,40%	2,58%	4,61%	12,44%	26,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	1,53%	2,41%	4,33%	11,41%	25,72%	0,20%	0,651%	2,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,28%	1,64%	3,39%	9,43%	22,90%	0,20%	0,356%	1,65%

IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	3,93%	4,77%	5,39%	10,63%	39,99%	0,20%	1,843%	9,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	1,64%	2,40%	4,03%	10,94%	26,21%	0,20%	0,607%	3,11%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,43%	-1,41%	-1,06%	0,64%	3,66%	9,89%	0,20%	4,703%	4,18%

IRF-M 1	0,54%	1,14%	1,71%	3,74%	9,85%	25,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	1,68%	3,65%	9,68%	25,09%	0,20%	0,075%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	1,11%	1,68%	3,63%	9,62%	24,91%	0,10%	0,074%	0,65%

IMA-B 5	0,54%	1,88%	2,78%	4,42%	11,72%	26,68%	-	-	-
---------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

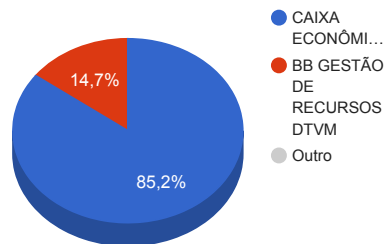
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	1,85%	2,73%	4,32%	11,52%	26,20%	0,20%	0,783%	3,43%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	1,01%	1,54%	3,42%	8,91%	24,05%	0,20%	0,021%	0,12%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,64%	1,66%	2,47%	4,01%	10,06%	-	0,002	0,447%	4,23%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,58%	1,95%	2,99%	4,90%	13,03%	33,18%	0,20%	0,838%	4,03%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

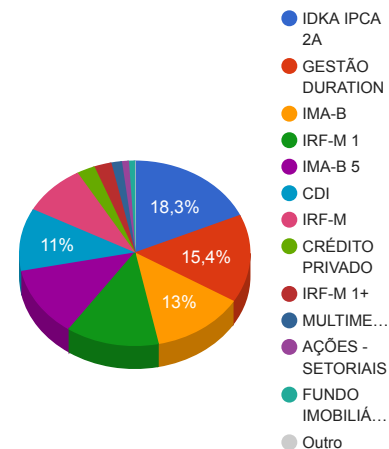
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,15%	3,82%	4,44%	10,91%	13,93%	69,83%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,18%	-	-	-	-	-	1,60%	0,532%	-
ICON	-3,58%	-2,27%	4,39%	5,21%	24,82%	47,64%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-3,58%	-2,28%	4,26%	4,48%	23,02%	43,49%	1,00%	8,705%	17,32%
IGC	-0,32%	7,86%	14,20%	14,63%	26,34%	80,98%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	7,74%	13,99%	14,12%	25,39%	78,71%	1,00%	10,134%	17,82%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (fevereiro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	292.250.850,62	85,21%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	50.495.152,10	14,72%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	239.648,09	0,07%



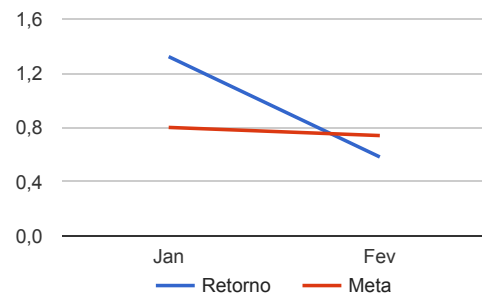
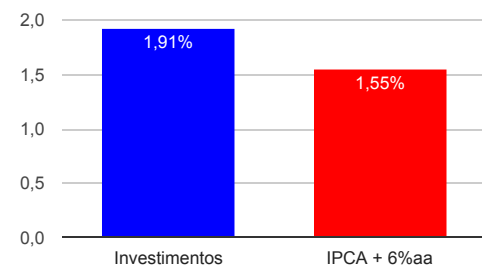
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	62.872.268,25	18,33%
GESTÃO DURATION	52.888.138,25	15,42%
IMA-B	44.664.273,71	13,02%
IRF-M 1	44.034.836,19	12,84%
IMA-B 5	41.805.499,57	12,19%
CDI	37.592.177,71	10,96%
IRF-M	30.523.832,65	8,90%
CRÉDITO PRIVADO	8.769.078,79	2,56%
IRF-M 1+	8.295.283,33	2,42%
MULTIMERCADO	5.069.025,00	1,48%
AÇÕES - SETORIAIS	3.309.751,04	0,96%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.921.838,23	0,85%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	239.648,09	0,07%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	331.118.244,39	79.160.099,48	77.138.165,90	337.541.570,08	4.401.392,11	1,32%	0,80%	164,84%	0,58%
Fevereiro	337.541.570,08	6.833.180,96	3.613.681,45	342.746.002,72	1.984.933,13	0,58%	0,74%	78,89%	0,91%
Acumulado no ano					6.386.325,24	1,91%	1,55%	123,65%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.180.004,20	0,00	0,00	8.295.283,33	115.279,13	1,41%	1,15%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.171.007,69	0,00	0,00	30.523.832,65	352.824,96	1,17%	0,84%	1,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	52.549.207,27	0,00	0,00	52.888.138,25	338.930,98	0,64%	0,45%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.220.265,08	0,00	370.351,31	12.933.218,91	83.305,14	0,63%	0,15%	0,64%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	8.718.324,02	0,00	0,00	8.769.078,79	50.754,77	0,58%	0,84%	0,58%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.474.011,65	0,00	0,00	57.799.543,80	325.532,15	0,57%	0,65%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.411.930,62	0,00	0,00	25.549.541,60	137.610,98	0,54%	1,84%	0,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.731.805,46	0,00	0,00	20.842.052,03	110.246,57	0,53%	0,78%	0,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	34.899.671,04	0,00	2.354.700,00	32.727.808,71	182.837,67	0,52%	0,07%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.815.487,86	1.437.867,80	0,00	11.307.027,48	53.671,82	0,48%	0,07%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.323.050,16	0,00	169.892,16	6.181.513,20	28.355,20	0,45%	0,61%	0,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.036.327,03	5.395.313,16	0,00	37.592.177,71	160.537,52	0,43%	0,02%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.205.780,82	0,00	145.466,24	5.072.724,45	12.409,87	0,24%	0,36%	0,24%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.485.708,17	0,00	573.271,74	20.963.447,54	51.011,11	0,24%	4,70%	-2,43%
Total Renda Fixa					2.003.307,87	0,61%	0,84%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.009.895,00	0,00	0,00	5.069.025,00	59.130,00	1,18%	0,53%	1,18%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.915.318,25	0,00	0,00	2.921.838,23	6.519,98	0,22%	-	0,00%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.161.432,96	0,00	0,00	1.157.317,21	-4.115,75	-0,35%	10,13%	-0,35%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	2.232.342,80	0,00	0,00	2.152.433,83	-79.908,97	-3,58%	8,70%	-3,58%
Total Renda Variável					-18.374,74	-0,16%	3,96%	