

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018



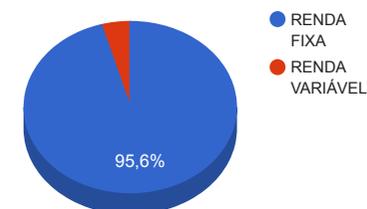
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			32.505,06	0,17%			Artigo 20
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.332.404,57	6,81%	698	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.548.854,13	18,13%	1.225	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.467.753,30	7,50%	745	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.434.204,36	27,76%	1.417	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.304.533,63	6,66%	180	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.391.677,96	7,11%	587	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.004.560,52	5,13%	716	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.442.974,87	7,37%	144	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	558.745,75	2,85%	748	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	60.932,80	0,31%	427	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	120.301,29	0,61%	37	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.016.966,63	5,19%	733	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	43832	861.734,25	4,40%	729	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	19.578.149,12				

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

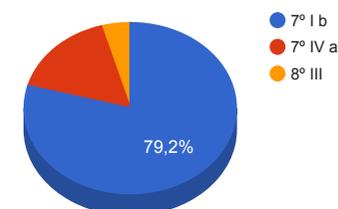
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	15.483.988,47	79,09%	0,00%	0,00%	100,00%	4.094.160,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	3.199.921,34	16,34%	0,00%	0,00%	30,00%	2.673.523,40
Total Renda Fixa	100,00%	18.683.909,81	95,43%	0,00	0,00	385,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	861.734,25	4,40%	0,00%	0,00%	5,00%	117.173,21
Total Renda Variável	30,00%	861.734,25	4,40%	0,00	0,00	38,00	-

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 "	15.483.988,47	79,09%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.199.921,34	16,34%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	18.683.909,81	95,43%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	861.734,25	4,40%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	861.734,25	4,40%	0,00	0,00

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	11.409.428,02	58,28%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.136.216,04	41,56%	-

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	1,10%	2,42%	3,69%	5,42%	13,07%	39,45%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,40%	3,66%	5,32%	12,77%	38,94%	0,20%	0,815%	4,49%
IMA Geral ex-C	0,72%	2,41%	3,33%	4,83%	11,12%	35,03%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	2,49%	3,42%	4,65%	10,51%	-	0,30%	0,871%	4,83%
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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	3,93%	4,77%	5,39%	10,57%	39,87%	0,20%	1,841%	9,07%
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%	-	-	-
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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	1,04%	1,63%	3,56%	9,05%	24,14%	0,20%	0,010%	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	1,02%	1,57%	3,46%	8,84%	23,93%	0,20%	0,005%	0,16%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,45%	1,02%	1,56%	3,45%	8,93%	24,02%	0,20%	0,010%	0,12%
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%

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

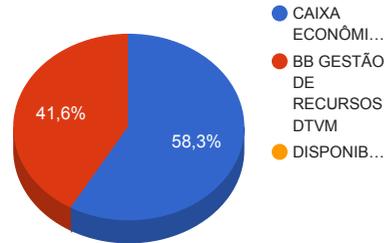
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,64%	1,66%	2,47%	4,01%	10,06%	-	0,002	0,447%	4,23%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

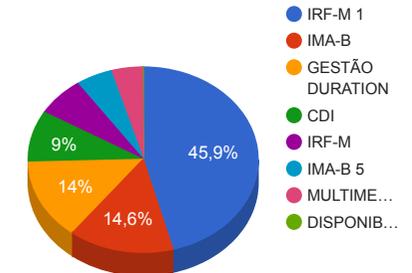
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,18%	-	-	-	-	-	1,60%	0,532%	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.409.428,02	58,28%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.136.216,04	41,56%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	32.505,06	0,17%



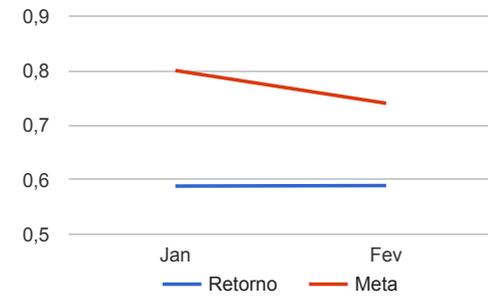
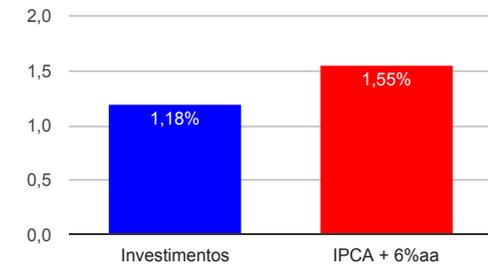
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.983.058,49	45,88%
IMA-B	2.859.431,26	14,61%
GESTÃO DURATION	2.747.508,50	14,03%
CDI	1.756.946,47	8,97%
IRF-M	1.332.404,57	6,81%
IMA-B 5	1.004.560,52	5,13%
MULTIMERCADO	861.734,25	4,40%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	32.505,06	0,17%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.114.796,24	3.180.488,84	1.411.492,78	18.994.909,23	111.116,93	0,59%	0,80%	73,42%	0,17%
Fevereiro	18.994.909,23	6.671.522,96	6.235.311,54	19.545.644,06	114.523,41	0,59%	0,74%	79,82%	0,52%
Acumulado no ano					225.640,34	1,18%	1,55%	76,42%	

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(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	318.637,84	1.000.000,00	0,00	1.332.404,57	13.766,73	1,04%	0,81%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.295.410,85	0,00	1.304.533,63	9.122,78	0,70%	0,87%	0,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	364.304,65	1.070.451,16	0,00	1.442.974,87	8.219,06	0,57%	0,45%	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.004.560,52	4.560,52	0,46%	0,78%	0,53%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	60.661,67	0,00	0,00	60.932,80	271,13	0,45%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	119.766,59	0,00	0,00	120.301,29	534,70	0,45%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	461.319,13	1.000.000,00	0,00	1.467.753,30	6.434,17	0,44%	1,84%	0,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	945.476,52	98.352,69	31.230,20	1.016.966,63	4.367,62	0,42%	0,02%	0,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	182.225,89	1.203.781,34	0,00	1.391.677,96	5.670,73	0,41%	1,84%	0,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.404.595,23	0,00	3.000.000,00	5.434.204,36	29.609,13	0,35%	0,07%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.529.843,90	0,00	2.000.000,00	3.548.854,13	19.010,23	0,34%	0,07%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.756.395,66	3.526,92	1.204.081,34	558.745,75	2.904,51	0,17%	0,01%	0,47%
Total Renda Fixa					104.471,31	0,56%	0,51%	

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	851.682,15	0,00	0,00	861.734,25	10.052,10	1,18%	0,53%	1,18%
Total Renda Variável					10.052,10	1,18%	0,53%	