

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 2019)

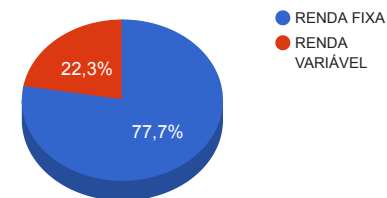
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	343.897,80	16,58%	576	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	118.336,33	5,71%	920	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	279.254,29	13,47%	1.250	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	242.428,98	11,69%	873	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	98.829,98	4,77%	889	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	273.181,69	13,17%	719	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.036,72	0,05%	15.850	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	253.352,98	12,22%	744	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	248.170,99	11,97%	118	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	132.581,24	6,39%	232	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	82.560,80	3,98%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		Total	2.073.631,80				

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

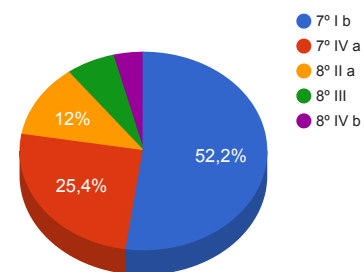
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.082.747,38	52,22%	20,00%	30,00%	100,00%	990.884,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.244.179,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	527.571,39	25,44%	10,00%	30,00%	40,00%	301.881,33
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	248.170,99	11,97%	0,00%	15,00%	20,00%	166.555,37
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	132.581,24	6,39%	7,00%	10,00%	10,00%	74.781,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	82.560,80	3,98%	2,00%	5,00%	5,00%	21.120,79
Total Carteira		2.073.631,80					

RENDA FIXA	1.610.318,77	77,66%
RENDA VARIÁVEL	463.313,03	22,34%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.082.747,38	52,22%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	527.571,39	25,44%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
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 "	248.170,99	11,97%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	132.581,24	6,39%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	82.560,80	3,98%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	2.073.631,80	100,00%	49,00	260,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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	1.772.867,97	85,50%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	300.763,83	14,50%	0,00%

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

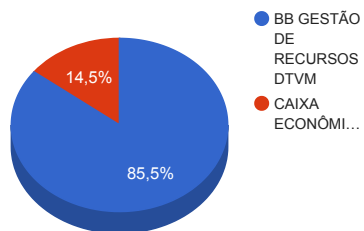
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,70%	7,16%	4,22%	7,16%	14,42%	25,32%	0,20%	1,349%	2,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,70%	7,17%	4,20%	7,17%	14,47%	25,32%	0,20%	1,343%	2,98%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,98%	3,39%	5,98%	12,17%	23,08%	0,20%	0,954%	1,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,76%	3,19%	5,76%	11,97%	22,82%	0,20%	0,911%	1,98%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,10%	0,171%	0,49%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	3,01%	1,50%	3,01%	6,19%	14,07%	0,20%	0,003%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,53%	1,27%	2,53%	5,19%	11,74%	1,00%	0,004%	0,10%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,09%	0,58%	0,29%	0,58%	1,18%	3,39%	5,00%	0,000%	0,02%

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

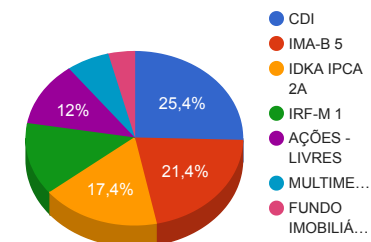
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2,89%	21,90%	7,96%	21,90%	59,91%	-	2,00%	6,580%	23,97%
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,18%	2,24%	0,98%	2,24%	12,66%	-3,55%	1,20%	2,628%	9,90%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,69%	4,16%	2,26%	4,16%	7,97%	17,52%	0,60%	0,283%	1,50%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.772.867,97	85,50%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	300.763,83	14,50%



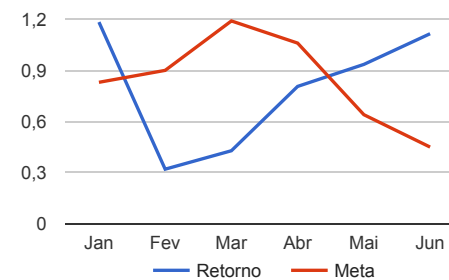
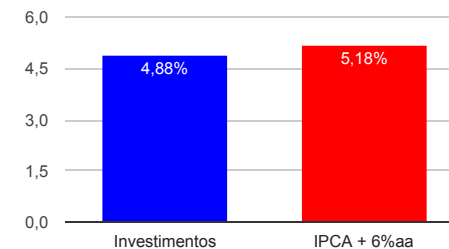
Sub-segmento	Valor	%
CDI	527.571,39	25,44%
IMA-B 5	442.727,78	21,35%
IDKA IPCA 2A	360.765,31	17,40%
IRF-M 1	279.254,29	13,47%
AÇÕES - LIVRES	248.170,99	11,97%
MULTIMERCADO	132.581,24	6,39%
FUNDO IMOBILIÁRIO	82.560,80	3,98%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	2.113.467,54	1.639.891,86	1.598.583,07	2.180.274,01	25.497,68	1,18%	0,83%	142,29%	1,25%
Fevereiro	2.180.274,01	370.961,31	531.152,35	2.027.066,38	6.983,41	0,32%	0,90%	35,77%	0,95%
Março	2.027.066,38	503.324,08	1.065.984,56	1.473.091,30	8.685,40	0,43%	1,19%	35,90%	0,95%
Abril	1.473.091,30	921.616,42	464.970,03	1.945.289,63	15.551,94	0,81%	1,06%	76,06%	0,93%
Mai	1.945.289,63	635.212,66	538.554,67	2.061.041,04	19.093,42	0,94%	0,64%	145,95%	1,53%
Junho	2.061.041,04	553.723,39	564.114,14	2.073.631,80	22.981,51	1,12%	0,45%	247,60%	1,38%
Acumulado no ano					98.793,36	4,88%	5,18%	94,28%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	97.179,61	0,00	0,00	98.829,98	1.650,37	1,70%	1,34%	1,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	116.911,28	0,00	0,00	118.336,33	1.425,05	1,22%	0,95%	1,22%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	328.153,60	280.255,67	270.000,00	343.897,80	5.488,53	0,90%	1,35%	1,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	339.774,72	0,00	100.000,00	242.428,98	2.654,26	0,78%	0,91%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	277.664,60	0,00	0,00	279.254,29	1.589,69	0,57%	0,17%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	172.525,14	80.000,00	0,00	253.352,98	827,84	0,33%	0,00%	0,46%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	274.055,77	142.389,72	144.072,14	273.181,69	808,34	0,19%	0,00%	0,39%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.078,00	42,00	1.036,72	0,72	0,07%	0,00%	0,09%
Total Renda Fixa					14.444,80	0,90%	0,61%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	241.206,65	0,00	0,00	248.170,99	6.964,34	2,89%	6,58%	2,89%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	81.597,60	0,00	0,00	82.560,80	963,20	1,18%	2,63%	1,18%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	131.972,07	50.000,00	50.000,00	132.581,24	609,17	0,33%	0,28%	0,69%
Total Renda Variável					8.536,71	1,88%	4,07%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	236.485,21	515.255,67	420.000,00	343.897,80	12.156,92	2,76%	4,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	268.901,08	147.399,61	182.000,00	242.428,98	8.128,29	2,62%	3,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	272.427,86	32.000,00	30.000,00	279.254,29	4.826,43	1,64%	1,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	257.861,92	729.558,26	717.724,62	273.181,69	3.486,13	0,65%	1,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.490,93	70.000,00	0,00	98.829,98	3.339,05	3,50%	4,20%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	213.189,25	137.000,00	100.000,00	253.352,98	3.163,73	1,20%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.999,99	95.196,09	0,00	118.336,33	3.140,25	2,73%	3,39%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.078,00	42,00	1.036,72	0,72	0,07%	0,29%
				Total Renda Fixa	38.241,52	2,42%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	233.064,84	0,00	248.170,99	15.106,15	8,00%	7,96%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	67.712,68	150.000,00	88.000,00	132.581,24	2.868,56	1,69%	2,26%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	81.760,00	0,00	560,00	82.560,80	1.360,80	1,68%	0,98%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4.602,35	0,00	4.685,85	0,00	83,50	1,81%	6,32%
				Total Renda Variável	19.419,01	4,60%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	24.660,03	0,00	24.626,37	0,00	-33,66	-0,14%	2,25%
			Total Exterior		-33,66	-0,14%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	140.855,40	939.238,47	755.000,00	343.897,80	18.803,93	4,30%	7,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	921.627,06	374.179,28	1.072.000,00	242.428,98	18.622,64	4,23%	5,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	262.414,08	337.609,22	330.000,00	279.254,29	9.230,99	2,70%	3,21%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	209.029,91	477.000,00	440.000,00	253.352,98	7.323,07	2,31%	3,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	130.048,62	1.800.290,46	1.663.488,01	273.181,69	6.330,62	1,17%	2,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	95.490,93	0,00	98.829,98	3.339,05	3,50%	7,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	115.196,08	0,00	118.336,33	3.140,25	2,73%	5,98%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	43.130,13	1.920,00	45.626,64	0,00	576,51	1,30%	2,65%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.078,00	42,00	1.036,72	0,72	0,07%	0,58%
				Total Renda Fixa	67.367,78	4,14%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	233.064,84	0,00	248.170,99	15.106,15	8,00%	21,90%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	279.014,67	150.000,00	303.000,00	132.581,24	6.566,57	3,52%	4,16%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	80.748,80	0,00	2.480,00	82.560,80	4.292,00	5,36%	2,24%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	24.778,10	99.662,44	127.095,80	0,00	2.655,26	3,92%	15,05%
				Total Renda Variável	28.619,98	7,72%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	21.820,77	0,00	24.626,37	0,00	2.805,60	12,86%	15,55%
			Total Exterior		2.805,60	12,86%	