

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2019)

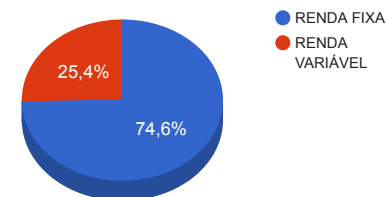
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	368.513,27	17,48%	597	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	99.766,08	4,73%	902	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	119.421,97	5,66%	937	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	281.206,82	13,34%	1.230	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	304.260,36	14,43%	877	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.556,24	0,07%	15.866	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	189.403,15	8,98%	724	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	208.471,34	9,89%	720	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	250.912,91	11,90%	148	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	198.916,80	9,43%	227	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	86.164,80	4,09%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			2.108.593,74				

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

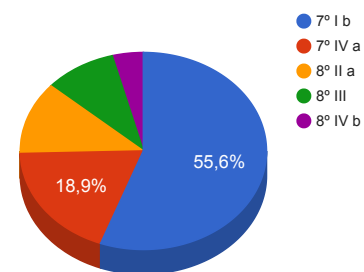
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.173.168,50	55,64%	20,00%	30,00%	100,00%	935.425,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.265.156,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	399.430,73	18,94%	10,00%	30,00%	40,00%	444.006,77
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	250.912,91	11,90%	0,00%	15,00%	20,00%	170.805,84
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	198.916,80	9,43%	7,00%	10,00%	10,00%	11.942,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	86.164,80	4,09%	2,00%	5,00%	5,00%	19.264,89
Total Carteira		2.108.593,74					

RENDA FIXA	1.572.599,23	74,58%
RENDA VARIÁVEL	535.994,51	25,42%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.173.168,50	55,64%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	399.430,73	18,94%	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 "	250.912,91	11,90%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	198.916,80	9,43%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	86.164,80	4,09%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	2.108.593,74	100,00%	49,00	260,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	1.801.684,65	85,44%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	306.909,09	14,56%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,80%	3,06%	5,52%	11,69%	21,08%	0,20%	0,584%	1,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	6,95%	3,23%	5,61%	11,87%	21,28%	0,20%	0,578%	1,92%

IMA-B 5	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	8,20%	4,09%	6,58%	13,86%	23,03%	0,20%	0,759%	2,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,18%	4,07%	6,55%	13,88%	23,03%	0,20%	0,752%	2,96%

IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%

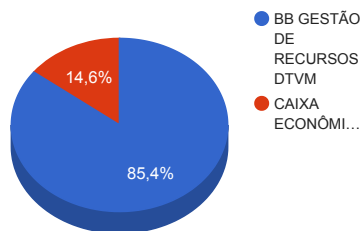
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	3,57%	1,54%	3,03%	6,22%	13,77%	0,20%	0,003%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	3,01%	1,31%	2,55%	5,21%	11,47%	1,00%	0,005%	0,11%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,11%	0,69%	0,30%	0,58%	1,18%	3,11%	5,00%	0,000%	0,02%

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

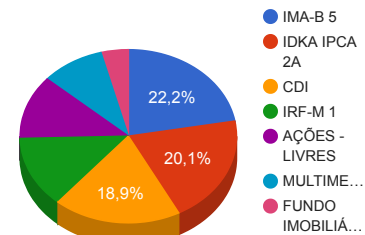
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,27%	13,10%	6,02%	10,37%	23,45%	28,72%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,37%	6,71%	6,12%	3,07%	9,92%	-2,00%	1,20%	6,136%	8,36%
Ibovespa	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,10%	23,24%	5,90%	6,91%	50,57%	-	2,00%	6,051%	23,88%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,41%	4,59%	1,88%	3,75%	7,15%	16,20%	0,60%	0,261%	1,39%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.801.684,65	85,44%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	306.909,09	14,56%



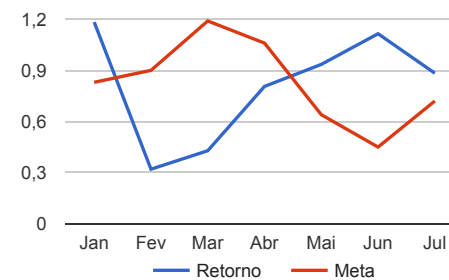
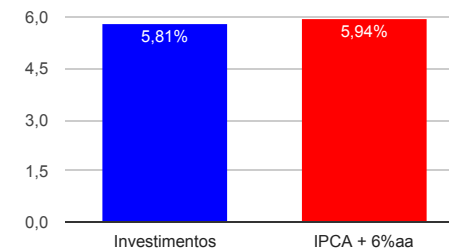
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	468.279,35	22,21%
IDKA IPCA 2A	423.682,33	20,09%
CDI	399.430,73	18,94%
IRF-M 1	281.206,82	13,34%
AÇÕES - LIVRES	250.912,91	11,90%
MULTIMERCADO	198.916,80	9,43%
FUNDO IMOBILIÁRIO	86.164,80	4,09%



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%
Julho	2.073.631,80	685.378,33	668.879,71	2.108.593,74	18.463,32	0,88%	0,72%	121,97%	1,30%
Acumulado no ano					117.256,68	5,81%	5,94%	97,78%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 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	98.829,98	0,00	0,00	99.766,08	936,10	0,95%	0,75%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	118.336,33	0,00	0,00	119.421,97	1.085,64	0,92%	0,58%	0,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	279.254,29	0,00	0,00	281.206,82	1.952,53	0,70%	0,12%	0,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	343.897,80	326.462,43	306.000,00	368.513,27	4.153,04	0,62%	0,76%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	242.428,98	109.014,28	49.000,00	304.260,36	1.817,10	0,52%	0,58%	0,98%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	253.352,98	15.000,00	80.000,00	189.403,15	1.050,17	0,39%	0,00%	0,55%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	273.181,69	68.114,17	133.837,71	208.471,34	1.013,19	0,30%	0,00%	0,47%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.036,72	560,00	42,00	1.556,24	1,52	0,10%	0,00%	0,11%
Total Renda Fixa					12.009,29	0,75%	0,41%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	82.560,80	0,00	0,00	86.164,80	3.604,00	4,37%	6,14%	4,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	248.170,99	0,00	0,00	250.912,91	2.741,92	1,10%	6,05%	1,10%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	132.581,24	166.227,45	100.000,00	198.916,80	108,11	0,04%	0,26%	0,41%
Total Renda Variável					6.454,03	1,22%	3,92%	