

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2019)

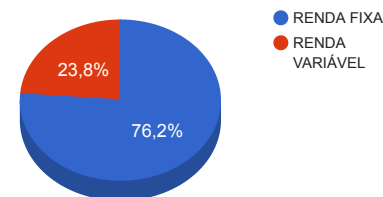
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	315.284,70	15,44%	605	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	99.800,92	4,89%	915	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	119.541,42	5,86%	940	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	282.660,47	13,85%	1.214	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	264.531,39	12,96%	875	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	2.075,45	0,10%	15.875	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	313.889,07	15,38%	701	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	157.988,25	7,74%	733	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	248.654,88	12,18%	169	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	149.346,57	7,32%	219	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	87.760,00	4,30%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			2.041.533,12				

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

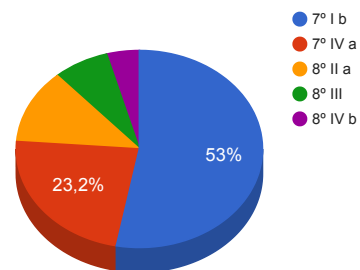
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.081.818,90	52,99%	20,00%	30,00%	100,00%	959.714,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.224.919,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	473.952,77	23,22%	10,00%	30,00%	40,00%	342.660,48
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	248.654,88	12,18%	0,00%	15,00%	20,00%	159.651,74
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	149.346,57	7,32%	7,00%	10,00%	10,00%	54.806,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	87.760,00	4,30%	2,00%	5,00%	5,00%	14.316,66
Total Carteira		2.041.533,12					

RENDA FIXA	1.555.771,67	76,21%
RENDA VARIÁVEL	485.761,45	23,79%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.081.818,90	52,99%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	473.952,77	23,22%	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 "	248.654,88	12,18%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	149.346,57	7,32%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	87.760,00	4,30%	2,00%	5,00%
Total	2.041.533,12	100,00%	49,00	260,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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	1.732.355,33	84,86%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	309.177,79	15,14%	0,00%

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

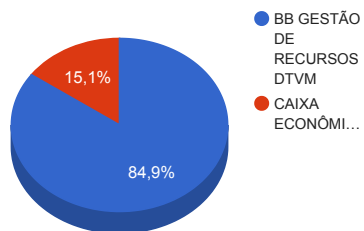
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,10%	0,181%	0,47%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,08%	1,51%	3,03%	6,16%	13,44%	0,20%	0,008%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	3,43%	1,26%	2,55%	5,15%	11,14%	1,00%	0,005%	0,10%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,06%	0,75%	0,26%	0,55%	1,14%	2,82%	5,00%	0,003%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,10%	7,06%	2,25%	5,13%	11,98%	20,25%	0,20%	0,743%	1,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	6,86%	2,15%	4,94%	11,84%	19,96%	0,20%	0,710%	1,89%
IMA-B 5	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	8,22%	2,70%	6,03%	14,23%	21,57%	0,20%	1,039%	2,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	8,23%	2,72%	6,06%	14,19%	21,56%	0,20%	1,022%	2,79%

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

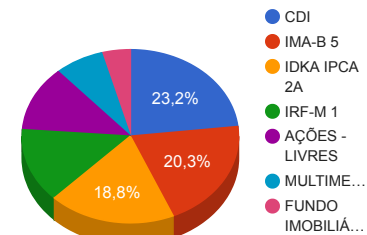
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,14%	1,63%	3,68%	8,27%	15,85%	0,60%	1,866%	0,74%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,90%	22,13%	3,09%	9,40%	52,10%	-	2,00%	11,657%	23,65%
IFIX	-0,11%	12,97%	4,07%	9,12%	24,18%	27,48%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,85%	8,68%	7,55%	6,17%	15,90%	7,65%	1,20%	7,705%	6,97%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.732.355,33	84,86%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	309.177,79	15,14%



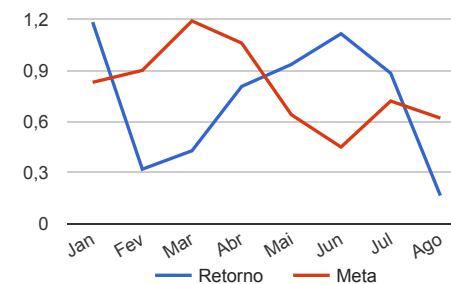
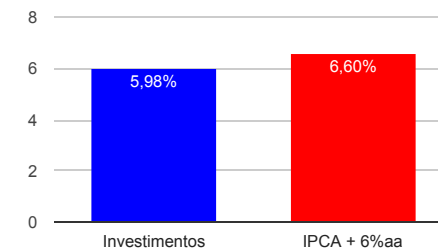
Sub-segmento	Valor	%
CDI	473.952,77	23,22%
IMA-B 5	415.085,62	20,33%
IDKA IPCA 2A	384.072,81	18,81%
IRF-M 1	282.660,47	13,85%
AÇÕES - LIVRES	248.654,88	12,18%
MULTIMERCADO	149.346,57	7,32%
FUNDO IMOBILIÁRIO	87.760,00	4,30%



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%
Agosto	2.108.593,74	455.346,58	525.896,10	2.041.533,12	3.488,90	0,17%	0,62%	26,66%	2,26%
Acumulado no ano					120.745,58	5,98%	6,60%	90,69%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	281.206,82	0,00	0,00	282.660,47	1.453,65	0,52%	0,18%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	189.403,15	123.415,29	0,00	313.889,07	1.070,63	0,34%	0,01%	0,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	208.471,34	14.672,68	65.854,10	157.988,25	698,33	0,31%	0,00%	0,41%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	119.421,97	0,00	0,00	119.541,42	119,45	0,10%	0,74%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	304.260,36	50.000,00	90.000,00	264.531,39	271,03	0,08%	0,71%	0,05%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.556,24	560,00	42,00	2.075,45	1,21	0,06%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	99.766,08	0,00	0,00	99.800,92	34,84	0,03%	1,04%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	368.513,27	266.698,61	320.000,00	315.284,70	72,82	0,01%	1,02%	0,03%
Total Renda Fixa					3.721,96	0,24%	0,49%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	86.164,80	0,00	0,00	87.760,00	1.595,20	1,85%	7,71%	1,85%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	198.916,80	0,00	50.000,00	149.346,57	429,77	0,22%	1,87%	0,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	250.912,91	0,00	0,00	248.654,88	-2.258,03	-0,90%	11,66%	-0,90%
Total Renda Variável					-233,06	-0,04%	7,93%	