

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2019)

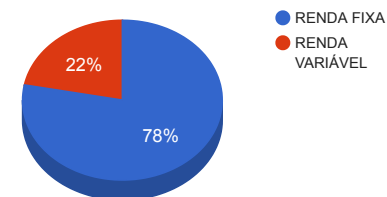
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	103.181,70	4,93%	924	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	122.791,98	5,87%	943	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	286.113,93	13,68%	1.208	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	322.203,75	15,41%	879	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	294.481,44	14,08%	611	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	3.194,46	0,15%	15.886	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	309.610,34	14,80%	679	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	190.527,56	9,11%	733	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	309.299,62	14,79%	200	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	54.336,67	2,60%	211	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	95.520,00	4,57%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			2.091.261,45				

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

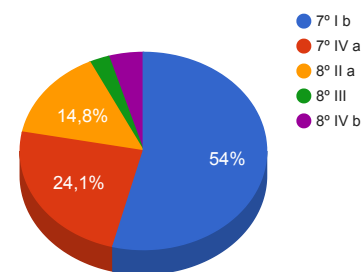
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.128.772,80	53,98%	20,00%	30,00%	100,00%	962.488,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.254.756,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	503.332,36	24,07%	10,00%	30,00%	40,00%	333.172,22
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	309.299,62	14,79%	0,00%	15,00%	20,00%	108.952,67
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	54.336,67	2,60%	7,00%	10,00%	10,00%	154.789,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	95.520,00	4,57%	2,00%	5,00%	5,00%	9.043,07
Total Carteira		2.091.261,45					

RENDA FIXA	1.632.105,16	78,04%
RENDA VARIÁVEL	459.156,29	21,96%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.128.772,80	53,98%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	503.332,36	24,07%	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 "	309.299,62	14,79%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	54.336,67	2,60%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	95.520,00	4,57%	2,00%	5,00%
Total	2.091.261,45	100,00%	49,00	260,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	1.766.573,31	84,47%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	324.688,14	15,53%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,65%	12,09%	3,47%	7,74%	13,78%	24,36%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,64%	11,90%	3,43%	7,66%	13,56%	23,88%	0,20%	0,987%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	11,89%	3,42%	7,63%	13,58%	23,88%	0,20%	0,974%	2,06%

IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	10,48%	2,93%	6,70%	12,06%	22,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	9,97%	2,82%	6,15%	11,39%	21,52%	0,20%	0,763%	1,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	9,71%	2,72%	5,87%	11,17%	21,20%	0,20%	0,815%	1,54%

IRF-M 1	0,62%	5,96%	1,83%	3,85%	7,13%	14,70%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	5,75%	1,75%	3,71%	6,87%	14,19%	0,10%	0,149%	0,27%

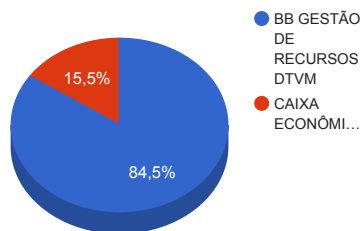
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,44%	5,01%	1,39%	2,95%	6,02%	12,94%	0,20%	0,008%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	4,21%	1,17%	2,49%	5,06%	10,74%	1,00%	0,003%	0,10%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,06%	0,86%	0,17%	0,47%	1,05%	2,45%	5,00%	0,016%	0,07%

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

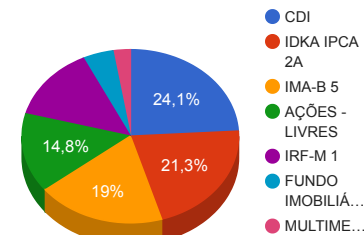
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	4,01%	18,73%	4,98%	11,30%	24,51%	25,41%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,57%	18,29%	10,86%	17,64%	21,84%	10,56%	1,20%	11,588%	9,37%
Ibovespa	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,26%	26,34%	2,51%	8,56%	31,71%	-	2,00%	8,065%	15,82%
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,77%	7,33%	2,62%	4,55%	8,46%	16,80%	0,60%	1,210%	0,85%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.766.573,31	84,47%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	324.688,14	15,53%



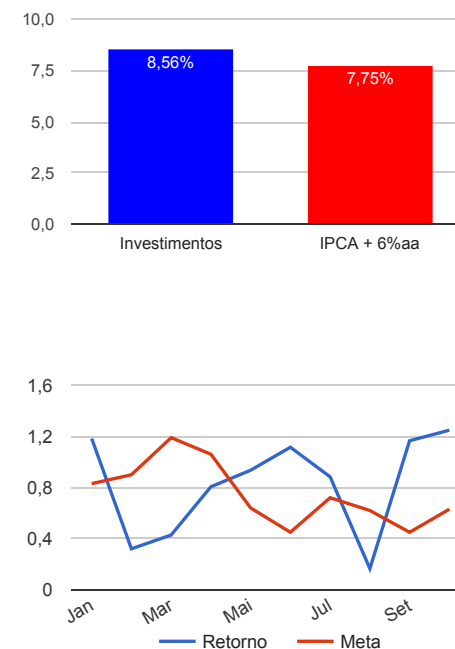
Sub-segmento	Valor	%
CDI	503.332,36	24,07%
IDKA IPCA 2A	444.995,73	21,28%
IMA-B 5	397.663,14	19,02%
AÇÕES - LIVRES	309.299,62	14,79%
IRF-M 1	286.113,93	13,68%
FUNDO IMOBILIÁRIO	95.520,00	4,57%
MULTIMERCADO	54.336,67	2,60%



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%
Setembro	2.041.533,12	652.206,02	682.376,99	2.035.165,22	23.803,07	1,17%	0,45%	261,09%	1,53%
Outubro	2.035.165,22	717.719,70	687.409,01	2.091.261,45	25.785,54	1,25%	0,63%	196,98%	2,13%
Acumulado no ano					170.334,19	8,56%	7,75%	110,39%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 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	101.517,62	0,00	0,00	103.181,70	1.664,08	1,64%	0,97%	1,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	121.244,22	0,00	0,00	122.791,98	1.547,76	1,28%	0,76%	1,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	298.330,33	100.000,00	80.000,00	322.203,75	3.873,42	0,97%	0,82%	1,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	291.577,14	288.000,00	290.000,00	294.481,44	4.904,30	0,85%	0,99%	1,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	284.411,13	0,00	0,00	286.113,93	1.702,80	0,60%	0,15%	0,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	174.908,71	133.816,47	0,00	309.610,34	885,16	0,29%	0,01%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	191.824,99	195.263,23	197.367,01	190.527,56	806,35	0,21%	0,00%	0,38%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.594,54	640,00	42,00	3.194,46	1,92	0,06%	0,02%	0,06%
Total Renda Fixa					15.385,79	0,95%	0,49%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 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	88.801,60	0,00	0,00	95.520,00	6.718,40	7,57%	11,59%	7,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	305.446,01	0,00	0,00	309.299,62	3.853,61	1,26%	8,07%	1,26%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	174.508,93	0,00	120.000,00	54.336,67	-172,26	-0,10%	1,21%	0,77%
Total Renda Variável					10.399,75	1,83%	7,99%	