

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano 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 (dezembro / 2019)

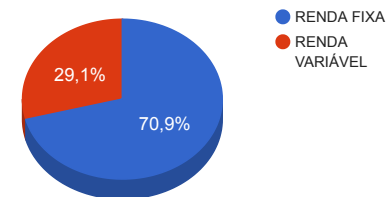
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	313.976,19	14,74%	613	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	124.155,08	5,83%	964	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	288.132,47	13,53%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	366.229,46	17,19%	876	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	107.103,66	5,03%	923	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	133.240,71	6,25%	726	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	2.396,31	0,11%	15.497	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	174.890,44	8,21%	654	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	346.247,40	16,25%	927	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	154.766,05	7,26%	203	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	119.199,20	5,60%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		Total	2.130.336,97				

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

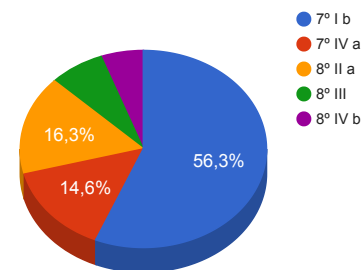
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.199.596,86	56,31%	20,00%	30,00%	100,00%	930.740,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.278.202,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	310.527,46	14,58%	10,00%	30,00%	40,00%	541.607,33
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	346.247,40	16,25%	0,00%	15,00%	20,00%	79.819,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	154.766,05	7,26%	7,00%	10,00%	10,00%	58.267,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	119.199,20	5,60%	2,00%	5,00%	5,00%	-12.682,35
Total Carteira		2.130.336,97					

RENDA FIXA	1.510.124,32	70,89%
RENDA VARIÁVEL	620.212,65	29,11%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.199.596,86	56,31%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	310.527,46	14,58%	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 "	346.247,40	16,25%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	154.766,05	7,26%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	119.199,20	5,60%	2,00%	5,00%
Total	2.130.336,97	100,00%	49,00	260,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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	1.777.482,72	83,44%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	352.854,25	16,56%	0,00%

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

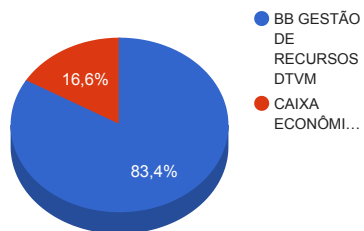
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,19%	12,89%	2,54%	5,34%	12,89%	23,78%	0,20%	1,002%	2,29%
IMA-B 5	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,21%	12,85%	2,52%	5,31%	12,85%	23,77%	0,20%	1,015%	2,31%
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	11,20%	2,62%	5,15%	11,20%	21,46%	0,20%	0,751%	1,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	11,19%	2,40%	4,92%	11,19%	21,53%	0,20%	0,738%	1,60%
IRF-M 1	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	6,49%	1,31%	3,18%	6,49%	13,69%	0,10%	0,069%	0,40%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	5,74%	1,14%	2,65%	5,74%	12,44%	0,20%	0,013%	0,23%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	4,82%	0,97%	2,23%	4,82%	10,36%	1,00%	0,009%	0,20%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05%	0,98%	0,18%	0,40%	0,98%	2,25%	5,00%	0,007%	0,08%

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

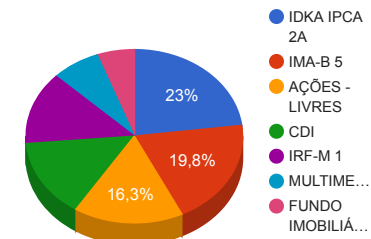
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,81%	41,43%	13,36%	16,02%	41,43%	-	2,00%	4,042%	16,51%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	9,03%	2,36%	4,67%	9,03%	16,60%	0,60%	0,365%	0,81%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	9,96%	47,62%	34,23%	44,38%	47,62%	39,25%	1,20%	13,663%	16,78%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.777.482,72	83,44%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	352.854,25	16,56%



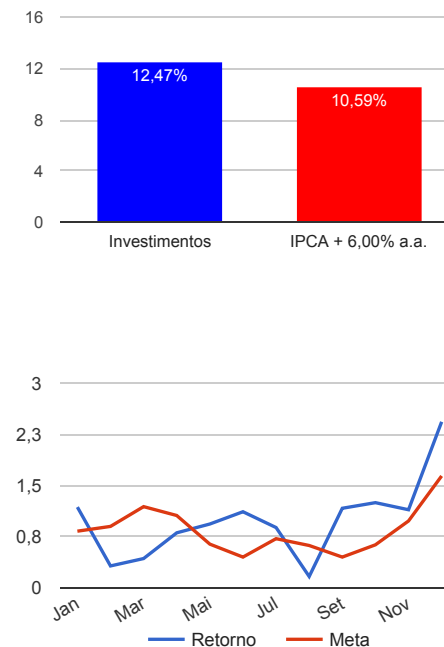
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	490.384,54	23,02%
IMA-B 5	421.079,85	19,77%
AÇÕES - LIVRES	346.247,40	16,25%
CDI	310.527,46	14,58%
IRF-M 1	288.132,47	13,53%
MULTIMERCADO	154.766,05	7,26%
FUNDO IMOBILIÁRIO	119.199,20	5,60%



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%
Novembro	2.091.261,45	416.237,10	433.312,90	2.098.119,16	23.933,51	1,14%	0,98%	117,27%	2,07%
Dezembro	2.098.119,16	738.866,26	757.722,89	2.130.336,97	51.074,44	2,43%	1,64%	148,22%	1,83%
Acumulado no ano					245.342,14	12,47%	10,59%	117,78%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 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	105.827,29	0,00	0,00	107.103,66	1.276,37	1,21%	1,01%	1,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	122.804,73	0,00	0,00	124.155,08	1.350,35	1,10%	0,74%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	302.787,62	140.000,00	80.000,00	366.229,46	3.441,84	0,78%	0,75%	1,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	351.153,95	189.561,54	230.000,00	313.976,19	3.260,70	0,60%	1,00%	1,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	286.991,98	0,00	0,00	288.132,47	1.140,49	0,40%	0,07%	0,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	203.204,25	0,00	29.000,00	174.890,44	686,19	0,34%	0,01%	0,35%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	243.205,24	308.126,36	418.680,89	133.240,71	590,00	0,11%	0,01%	0,28%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	757,58	1.680,00	42,00	2.396,31	0,73	0,03%	0,01%	0,05%
Total Renda Fixa					11.746,67	0,73%	0,54%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 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	108.400,00	0,00	0,00	119.199,20	10.799,20	9,96%	13,66%	9,96%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	318.217,17	0,00	0,00	346.247,40	28.030,23	8,81%	4,04%	8,81%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	54.769,35	99.498,36	0,00	154.766,05	498,34	0,32%	0,36%	0,78%
Total Renda Variável					39.327,77	6,77%	4,97%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	298.330,33	340.000,00	280.000,00	366.229,46	7.899,13	1,90%	2,62%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	291.577,14	664.985,39	650.000,00	313.976,19	7.413,66	1,30%	2,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	284.411,13	0,00	0,00	288.132,47	3.721,34	1,31%	1,31%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	121.244,22	0,00	0,00	124.155,08	2.910,86	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	101.517,62	3.000,00	0,00	107.103,66	2.586,04	2,52%	2,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	174.908,71	187.416,34	189.788,31	174.890,44	2.353,70	0,84%	1,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	191.824,99	574.999,47	635.530,49	133.240,71	1.946,74	0,53%	0,97%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.594,54	2.923,50	3.126,00	2.396,31	4,27	0,13%	0,18%
				Total Renda Fixa	28.835,74	1,79%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	305.446,01	0,00	0,00	346.247,40	40.801,39	13,36%	13,36%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	88.801,60	0,00	0,00	119.199,20	30.397,60	34,23%	34,23%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	174.508,93	99.498,36	120.000,00	154.766,05	758,76	1,02%	2,36%
Total Renda Variável					71.957,75	13,99%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 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	2.500.627,58	2.361.000,00	313.976,19	33.493,21	6,85%	12,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	921.627,06	963.193,56	1.551.000,00	366.229,46	32.408,84	7,98%	11,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	262.414,08	337.609,22	330.000,00	288.132,47	18.109,17	5,96%	6,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	209.029,91	802.831,63	849.788,31	174.890,44	12.817,21	4,27%	5,74%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	130.048,62	2.593.564,95	2.601.045,30	133.240,71	10.672,44	2,56%	4,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	115.196,08	0,00	124.155,08	8.959,00	7,78%	11,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	98.490,93	0,00	107.103,66	8.612,73	8,99%	12,85%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	43.130,13	1.920,00	45.626,64	0,00	576,51	1,30%	5,07%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	5.681,50	3.294,00	2.396,31	8,81	0,39%	0,98%
				Total Renda Fixa	125.657,92	7,99%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	283.064,84	0,00	346.247,40	63.182,56	25,45%	41,43%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	80.748,80	0,00	2.480,00	119.199,20	40.930,40	52,11%	47,62%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	279.014,67	488.640,98	623.000,00	154.766,05	10.110,40	5,90%	9,03%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	24.778,10	99.662,44	127.095,80	0,00	2.655,26	3,92%	33,90%
				Total Renda Variável	116.878,62	26,47%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 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%	34,46%
Total Exterior					2.805,60	12,86%	