

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2019)

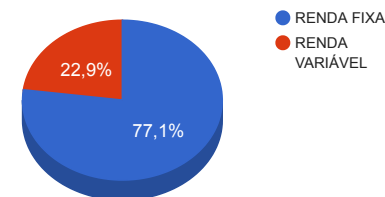
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	302.787,62	14,43%	876	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	105.827,29	5,04%	929	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	122.804,73	5,85%	956	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	351.153,95	16,74%	621	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	286.991,98	13,68%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	757,58	0,04%	15.776	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	203.204,25	9,69%	667	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	243.205,24	11,59%	732	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	318.217,17	15,17%	425	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	54.769,35	2,61%	209	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	108.400,00	5,17%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			2.098.119,16				

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

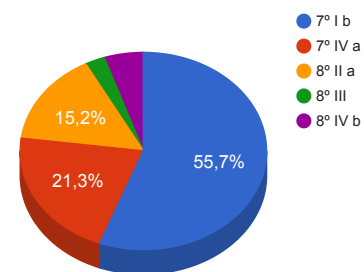
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.169.565,57	55,74%	20,00%	30,00%	100,00%	928.553,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	10,00%	60,00%	1.258.871,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	447.167,07	21,31%	10,00%	30,00%	40,00%	392.080,59
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	318.217,17	15,17%	0,00%	15,00%	20,00%	101.406,66
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	54.769,35	2,61%	7,00%	10,00%	10,00%	155.042,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	108.400,00	5,17%	2,00%	5,00%	5,00%	-3.494,04
Total Carteira		2.098.119,16					

RENDA FIXA	1.616.732,64	77,06%
RENDA VARIÁVEL	481.386,52	22,94%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: novembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.169.565,57	55,74%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	447.167,07	21,31%	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 "	318.217,17	15,17%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	54.769,35	2,61%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	108.400,00	5,17%	2,00%	5,00%
Total	2.098.119,16	100,00%	49,00	260,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 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	1.760.329,56	83,90%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	337.789,60	16,10%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,34%	5,37%	1,24%	2,76%	5,86%	12,70%	0,20%	0,010%	0,19%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	4,52%	1,06%	2,33%	4,95%	10,54%	1,00%	0,004%	0,16%

IRF-M 1	0,33%	6,31%	1,61%	3,49%	6,91%	14,37%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	6,07%	1,53%	3,36%	6,64%	13,87%	0,10%	0,079%	0,37%

IDKA IPCA 2 Anos	0,01%	10,49%	2,86%	5,28%	11,88%	22,68%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	9,94%	2,88%	5,10%	11,28%	21,11%	0,20%	0,510%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	9,98%	2,73%	5,04%	11,25%	21,26%	0,20%	0,499%	1,61%

IMA-B	-2,45%	20,53%	3,71%	8,53%	22,52%	37,40%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,31%	11,56%	3,07%	5,87%	13,06%	23,39%	0,20%	0,646%	2,31%

IMA-B 5	-0,28%	11,77%	3,13%	5,97%	13,30%	23,89%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	11,51%	3,04%	5,82%	13,05%	23,35%	0,20%	0,647%	2,33%

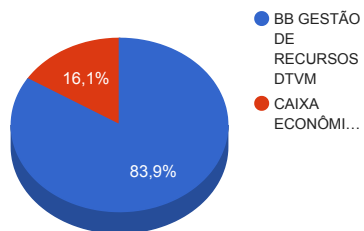
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,07%	0,93%	0,18%	0,44%	1,03%	2,35%	5,00%	0,000%	0,07%

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

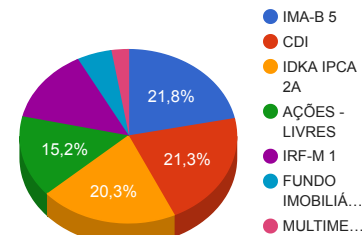
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,95%	23,15%	7,02%	11,55%	20,93%	50,38%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,88%	29,98%	6,42%	9,71%	29,09%	-	2,00%	5,941%	15,59%
CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	8,18%	2,89%	4,57%	8,65%	16,64%	0,60%	0,625%	0,85%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	13,48%	34,24%	23,52%	32,85%	33,37%	26,64%	1,20%	17,330%	15,08%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.760.329,56	83,90%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	337.789,60	16,10%



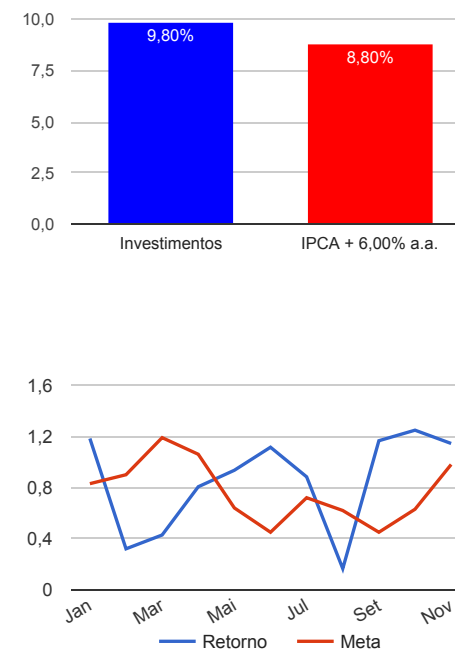
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	456.981,24	21,78%
CDI	447.167,07	21,31%
IDKA IPCA 2A	425.592,35	20,28%
AÇÕES - LIVRES	318.217,17	15,17%
IRF-M 1	286.991,98	13,68%
FUNDO IMOBILIÁRIO	108.400,00	5,17%
MULTIMERCADO	54.769,35	2,61%



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%
Acumulado no ano					194.267,70	9,80%	8,80%	111,32%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 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	286.113,93	0,00	0,00	286.991,98	878,05	0,31%	0,08%	0,31%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	309.610,34	53.599,87	160.788,31	203.204,25	782,35	0,22%	0,01%	0,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	190.527,56	71.609,88	19.482,59	243.205,24	550,39	0,21%	0,00%	0,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	322.203,75	100.000,00	120.000,00	302.787,62	583,87	0,14%	0,51%	0,21%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.194,46	603,50	3.042,00	757,58	1,62	0,04%	0,00%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	122.791,98	0,00	0,00	122.804,73	12,75	0,01%	0,50%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	294.481,44	187.423,85	130.000,00	351.153,95	-751,34	-0,16%	0,65%	-0,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	103.181,70	3.000,00	0,00	105.827,29	-354,41	-0,33%	0,65%	-0,34%
Total Renda Fixa					1.703,28	0,10%	0,33%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 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	95.520,00	0,00	0,00	108.400,00	12.880,00	13,48%	17,33%	13,48%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	309.299,62	0,00	0,00	318.217,17	8.917,55	2,88%	5,94%	2,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	54.336,67	0,00	0,00	54.769,35	432,68	0,80%	0,62%	0,80%
Total Renda Variável					22.230,23	4,84%	7,90%	