

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)

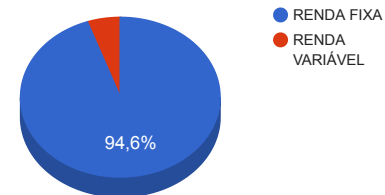
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.100.846,25	0,76%	119	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.130.232,17	7,69%	228	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.387.390,53	4,42%	352	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.212.904,49	9,13%	1.208	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	8.772.755,15	6,06%	107	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.790.161,14	10,91%	126	2,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.376.339,33	4,41%	966	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.387.275,97	5,11%	879	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.082.125,49	2,82%	943	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.604.990,46	5,26%	668	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.540.574,95	5,21%	1.372	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	11.755.476,78	8,13%	564	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	13.819.139,49	9,55%	304	0,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.904.859,40	2,70%	274	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	10.095.147,54	6,98%	679	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.042.262,49	4,87%	383	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	901.319,16	0,62%	733	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.485.512,22	2,41%	7.105	0,39%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.280.768,99	2,96%	16.354	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
		Total	144.670.082,00				

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

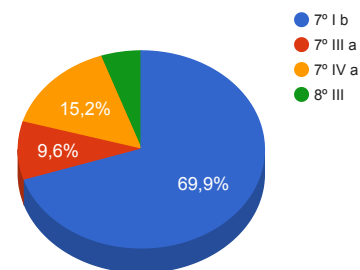
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	101.141.072,71	69,91%	15,00%	25,00%	70,00%	127.984,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	13.819.139,49	9,55%	5,00%	10,00%	60,00%	72.982.909,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	21.943.588,59	15,17%	10,00%	30,00%	40,00%	35.924.444,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.233.504,10
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	28.934.016,40
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.766.281,21	5,37%	7,00%	10,00%	10,00%	6.700.726,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.233.504,10
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.233.504,10
Total Carteira		144.670.082,00					

RENDA FIXA	136.903.800,79	94,63%
RENDA VARIÁVEL	7.766.281,21	5,37%

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 "	101.141.072,71	69,91%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	13.819.139,49	9,55%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	21.943.588,59	15,17%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
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 "	0,00	0,00%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	7.766.281,21	5,37%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	144.670.082,00	100,00%	50,00	240,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	74.134.700,74	51,24%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	70.535.381,26	48,76%	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+	4,67%	32,45%	7,73%	20,86%	37,00%	51,90%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,66%	32,02%	7,69%	20,68%	36,58%	50,95%	0,20%	2,807%	7,96%
IMA-B	3,36%	23,57%	5,89%	15,34%	26,74%	39,79%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,35%	23,19%	5,83%	15,09%	26,35%	39,24%	0,20%	1,924%	5,27%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,34%	23,21%	5,82%	15,13%	26,34%	39,12%	0,30%	1,918%	5,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,33%	23,33%	5,82%	15,17%	26,47%	39,19%	0,20%	1,925%	5,33%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,74%	1,27%	-1,01%	0,88%	2,32%	5,72%	0,20%	0,369%	4,11%
IMA Geral	1,72%	12,62%	3,38%	8,43%	14,80%	25,02%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,69%	12,16%	3,30%	8,18%	14,34%	24,00%	0,20%	0,845%	2,15%
IMA Geral ex-C	1,69%	12,40%	3,35%	8,30%	14,62%	24,51%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	13,06%	3,41%	8,88%	15,25%	25,21%	0,30%	0,927%	2,43%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69%	12,18%	3,30%	8,18%	14,34%	23,98%	0,20%	0,836%	2,13%
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,63%	7,75%	1,71%	3,57%	8,69%	20,40%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	6,91%	1,69%	3,63%	8,02%	17,55%	0,15%	0,368%	0,96%

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

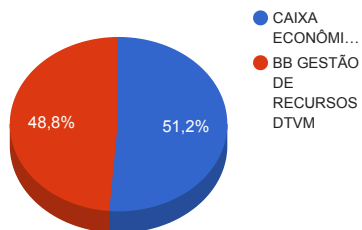
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,62%	5,96%	1,83%	3,85%	7,13%	14,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	5,79%	1,77%	3,74%	6,93%	14,31%	0,20%	0,148%	0,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	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%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	5,17%	1,48%	3,12%	6,18%	12,91%	0,20%	0,041%	0,12%
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%
IPCA	0,10%	2,60%	0,17%	0,50%	2,54%	7,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,71%	16,33%	3,73%	10,67%	18,32%	26,77%	0,002	1,122%	3,53%

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

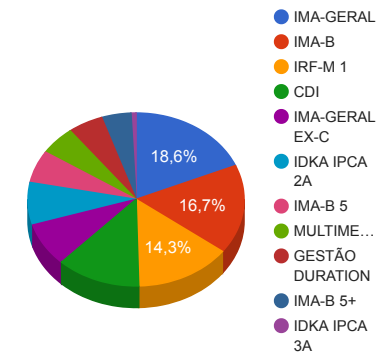
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,19%	10,02%	2,83%	5,74%	10,92%	20,66%	1,00%	2,458%	3,40%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,87%	14,79%	3,01%	8,89%	16,83%	27,11%	0,50%	1,480%	3,40%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	74.134.700,74	51,24%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	70.535.381,26	48,76%

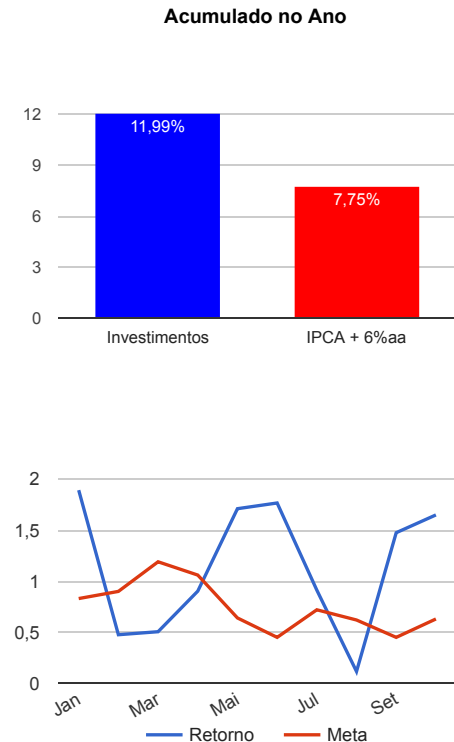


Sub-segmento	Valor	%
IMA-GERAL	26.920.393,31	18,61%
IMA-B	24.100.338,22	16,66%
IRF-M 1	20.753.479,44	14,35%
CDI	18.038.729,19	12,47%
IMA-GERAL EX-C	11.755.476,78	8,13%
IDKA IPCA 2A	11.469.401,46	7,93%
IMA-B 5	8.772.755,15	6,06%
MULTIMERCADO	7.766.281,21	5,37%
GESTÃO DURATION	7.604.990,46	5,26%
IMA-B 5+	6.387.390,53	4,42%
IDKA IPCA 3A	1.100.846,25	0,76%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	128.283.760,34	565.265,08	1.140.587,87	130.134.778,91	2.426.341,36	1,89%	0,83%	227,43%	0,74%
Fevereiro	130.134.778,91	2.520.489,69	2.193.263,23	131.082.808,93	620.803,56	0,48%	0,90%	53,14%	1,27%
Março	131.082.808,93	5.320.928,48	5.070.121,87	131.997.372,47	663.756,93	0,51%	1,19%	42,34%	1,66%
Abril	131.997.372,47	1.085.734,15	1.020.776,22	133.254.322,47	1.191.992,07	0,90%	1,06%	85,19%	0,71%
Mai	133.254.322,47	1.850.490,70	1.691.651,91	135.694.487,46	2.281.326,20	1,71%	0,64%	266,91%	0,89%
Junho	135.694.487,46	3.664.409,45	3.755.011,05	138.000.091,13	2.396.205,27	1,77%	0,45%	392,12%	1,02%
Julho	138.000.091,13	3.609.112,11	3.366.513,81	139.503.932,52	1.261.243,09	0,91%	0,72%	125,97%	0,63%
Agosto	139.503.932,52	2.883.925,01	2.743.215,16	139.806.537,62	161.895,25	0,12%	0,62%	18,68%	1,33%
Setembro	139.806.537,62	6.536.049,22	6.326.175,31	142.081.463,59	2.065.052,06	1,47%	0,45%	330,27%	0,91%
Outubro	142.081.463,59	2.149.243,91	1.907.343,00	144.670.082,00	2.346.717,50	1,65%	0,63%	260,17%	0,95%
Acumulado no ano					15.415.333,29	11,99%	7,75%	154,63%	



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(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.102.792,20	0,00	0,00	6.387.390,53	284.598,33	4,66%	2,81%	4,66%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	13.371.847,01	0,00	0,00	13.819.139,49	447.292,48	3,35%	1,92%	3,35%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.778.676,22	0,00	0,00	3.904.859,40	126.183,18	3,34%	1,92%	3,34%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.171.127,96	0,00	0,00	6.376.339,33	205.211,37	3,33%	1,92%	3,33%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.647.175,36	901.397,16	0,00	11.755.476,78	206.904,26	1,79%	0,93%	1,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.477.105,59	0,00	0,00	7.604.990,46	127.884,87	1,71%	1,12%	1,71%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.945.116,44	0,00	0,00	11.130.232,17	185.115,73	1,69%	0,84%	1,69%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.528.502,08	0,00	0,00	15.790.161,14	261.659,06	1,69%	0,84%	1,69%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.030.671,69	0,00	0,00	4.082.125,49	51.453,80	1,28%	0,76%	1,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.296.885,33	0,00	0,00	7.387.275,97	90.390,64	1,24%	0,82%	1,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.092.750,03	0,00	0,00	1.100.846,25	8.096,22	0,74%	0,37%	0,74%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.708.440,44	0,00	0,00	8.772.755,15	64.314,71	0,74%	0,37%	0,74%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.495.093,24	0,00	0,00	7.540.574,95	45.481,71	0,61%	0,15%	0,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.062.387,23	0,00	929.403,53	13.212.904,49	79.920,79	0,57%	0,15%	0,60%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.007.492,98	0,00	0,00	7.042.262,49	34.769,51	0,50%	0,04%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	10.051.140,82	0,00	0,00	10.095.147,54	44.006,72	0,44%	0,01%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	625.861,26	1.247.846,75	977.939,47	901.319,16	5.550,62	0,30%	0,00%	0,38%
				Total Renda Fixa	2.268.834,00	1,69%	0,90%	

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.444.487,21	0,00	0,00	3.485.512,22	41.025,01	1,19%	2,46%	1,19%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.243.910,50	0,00	0,00	4.280.768,99	36.858,49	0,87%	1,48%	0,87%
Total Renda Variável					77.883,50	1,01%	1,92%	