

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2019)

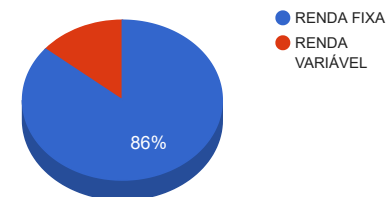
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	85.790.215,10	19,41%	600	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	71.802.342,96	16,24%	902	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	86.032,23	0,02%	1.230	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.944.193,30	9,04%	956	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.400.265,44	3,48%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	48.702.182,79	11,02%	355	1,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.946.600,31	0,89%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.828.692,86	3,13%	1.391	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	83.838.221,13	18,96%	937	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.223.676,43	0,50%	784	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	4.344.989,24	0,98%	76	2,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	10.272.941,51	2,32%	74	1,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	23.265.035,53	5,26%	93	5,71%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	17.383.026,97	3,93%	94	3,94%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.413.675,49	0,32%	168	0,27%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.097.160,76	0,70%	4.989	0,38%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	5.562.440,00	1,26%	729	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.007.039,05	1,13%	8.060	0,26%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	3.373.700,57	0,76%	955	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	2.795.954,39	0,63%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			442.078.386,06				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.542,20				Artigo 6º
Total			442.082.928,26				

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

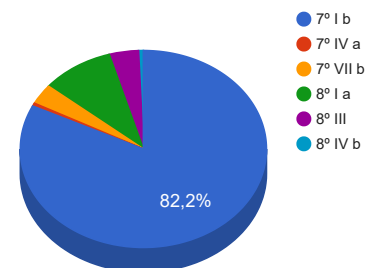
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	363.338.746,12	82,19%	15,00%	50,00%	90,00%	34.531.801,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	132.623.515,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	2.223.676,43	0,50%	5,00%	28,00%	35,00%	152.503.758,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	14.617.930,75	3,31%	1,00%	3,00%	5,00%	7.485.988,55
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	42.061.737,99	9,51%	2,00%	11,00%	15,00%	24.250.019,92
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	22.103.919,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	17.040.340,38	3,85%	1,00%	4,00%	10,00%	27.167.498,23
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.795.954,39	0,63%	0,00%	1,00%	5,00%	19.307.964,91
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	22.103.919,30
Total Carteira		442.078.386,06					

RENDA FIXA	380.184.895,50	86,00%
RENDA VARIÁVEL	61.898.032,76	14,00%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	363.338.746,12	82,19%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.223.676,43	0,50%	5,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	14.617.930,75	3,31%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	42.061.737,99	9,51%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	17.040.340,38	3,85%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.795.954,39	0,63%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	442.078.386,06	100,00%	24,00	215,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	408.162.916,69	92,33%	0,08%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.119.514,98	7,04%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.795.954,39	0,63%	0,24%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,51%	22,95%	12,19%	15,32%	38,55%	44,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,51%	22,61%	12,04%	15,10%	37,79%	43,76%	0,20%	1,891%	11,70%
IMA-B	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	16,55%	8,83%	11,64%	27,24%	35,12%	0,20%	1,344%	7,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	6,52%	2,81%	5,11%	11,77%	20,90%	0,20%	0,503%	2,21%
IDKA IPCA 2 Anos	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	6,95%	3,23%	5,61%	11,87%	21,28%	0,20%	0,578%	1,92%
IMA-B 5	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,18%	4,07%	6,55%	13,88%	23,03%	0,20%	0,752%	2,96%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,94%	1,83%	5,07%	9,36%	21,07%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	8,75%	4,22%	6,81%	15,25%	32,93%	0,20%	0,792%	3,64%
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	3,95%	1,94%	3,37%	7,11%	14,84%	0,20%	0,124%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	3,58%	1,55%	3,03%	6,19%	13,55%	0,20%	0,004%	0,13%
IPCA	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-	-

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

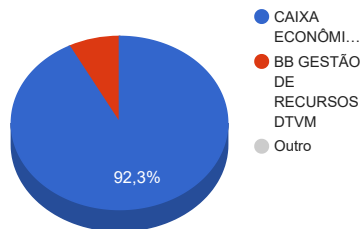
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	12,15%	6,69%	9,01%	16,92%	25,04%	0,002	1,027%	3,40%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,99%	10,99%	6,30%	8,92%	16,07%	22,75%	0,20%	1,111%	3,05%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,83%	7,62%	3,41%	6,07%	12,90%	24,58%	0,20%	0,568%	2,66%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

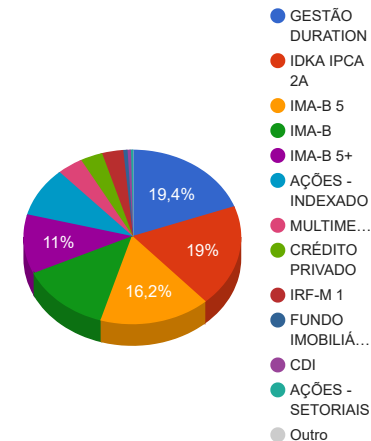
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	2,04%	18,25%	7,89%	7,50%	33,63%	50,67%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,66%	15,81%	6,27%	4,88%	31,29%	49,49%	1,00%	6,337%	15,70%
IFIX	1,27%	13,10%	6,02%	10,37%	23,45%	28,72%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
Ibovespa	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,78%	15,48%	5,55%	4,39%	27,92%	52,68%	0,50%	6,223%	15,08%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,76%	5,08%	2,96%	4,05%	-	-	1,60%	0,296%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,53%	3,15%	1,55%	2,58%	7,07%	-	1,60%	0,099%	1,79%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,32%	11,43%	5,71%	7,47%	17,52%	27,80%	0,50%	1,150%	3,88%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,62%	6,99%	2,83%	3,50%	12,06%	23,67%	1,00%	1,923%	4,41%
IBX-50	0,42%	14,61%	5,04%	3,77%	26,40%	51,89%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,65%	14,08%	5,39%	3,11%	24,02%	50,51%	0,70%	6,440%	15,18%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	408.162.916,69	92,33%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.915.469,37	7,67%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.542,20	0,00%



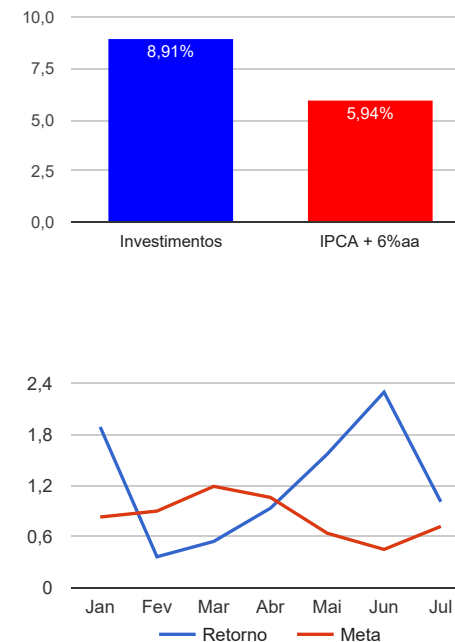
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	85.790.215,10	19,41%
IDKA IPCA 2A	83.838.221,13	18,96%
IMA-B 5	71.802.342,96	16,24%
IMA-B	59.291.059,05	13,41%
IMA-B 5+	48.702.182,79	11,02%
AÇÕES - INDEXADO	40.648.062,50	9,19%
MULTIMERCADO	17.040.340,38	3,85%
CRÉDITO PRIVADO	14.617.930,75	3,31%
IRF-M 1	13.914.725,09	3,15%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.795.954,39	0,63%
CDI	2.223.676,43	0,50%
AÇÕES - SETORIAIS	1.413.675,49	0,32%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.542,20	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	389.532.929,62	58.367.638,88	53.792.246,74	401.544.963,80	7.436.642,04	1,89%	0,83%	226,90%	1,19%
Fevereiro	401.544.963,80	23.042.199,51	21.631.720,60	404.420.435,99	1.464.993,28	0,36%	0,90%	40,60%	1,66%
Março	404.420.435,99	4.412.933,34	3.043.627,51	407.996.984,75	2.207.242,93	0,54%	1,19%	45,57%	2,53%
Abril	407.996.984,75	8.549.454,06	5.129.100,00	415.261.525,93	3.844.187,12	0,93%	1,06%	88,19%	1,39%
Mai	415.261.525,93	20.321.082,78	18.142.980,00	423.988.964,20	6.549.335,49	1,57%	0,64%	244,89%	1,76%
Junho	423.988.964,20	45.064.216,91	43.206.000,00	435.624.895,69	9.777.714,58	2,30%	0,45%	509,85%	2,09%
Julho	435.624.895,69	13.861.849,71	11.823.695,15	442.078.386,06	4.415.335,81	1,01%	0,72%	139,30%	1,46%
Acumulado no ano					35.695.451,25	8,91%	5,94%	150,02%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 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	44.430.186,09	3.552.700,44	0,00	48.702.182,79	719.296,26	1,50%	1,89%	1,51%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.207.102,57	5.293.489,82	0,00	39.944.193,30	443.600,91	1,12%	1,34%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	84.851.149,54	0,00	0,00	85.790.215,10	939.065,56	1,11%	1,03%	1,11%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.302.493,92	0,00	0,00	4.344.989,24	42.495,32	0,99%	1,11%	0,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.252.459,11	0,00	0,00	15.400.265,44	147.806,33	0,97%	0,79%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	71.128.618,29	0,00	0,00	71.802.342,96	673.724,67	0,95%	0,75%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	83.076.064,42	0,00	0,00	83.838.221,13	762.156,71	0,92%	0,58%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.914.219,99	0,00	0,00	3.946.600,31	32.380,32	0,83%	0,50%	0,83%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.188.657,89	0,00	0,00	10.272.941,51	84.283,62	0,83%	0,57%	0,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.966.424,18	0,00	3.250.000,00	13.828.692,86	112.268,68	0,66%	0,12%	0,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.211.504,60	0,00	0,00	2.223.676,43	12.171,83	0,55%	0,00%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.057.725,35	15.659,45	3.000.000,00	86.032,23	12.647,43	0,41%	0,12%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.539.356,28	0,00	5.555.095,15	0,00	15.738,87	0,28%	0,00%	0,54%
Total Renda Fixa					3.997.636,51	1,05%	0,95%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.779.119,06	0,00	18.600,00	2.795.954,39	35.435,33	1,28%	-	0,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	23.084.555,50	0,00	0,00	23.265.035,53	180.480,03	0,78%	6,22%	0,78%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.348.215,90	0,00	0,00	3.373.700,57	25.484,67	0,76%	0,30%	0,76%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.404.383,41	0,00	0,00	1.413.675,49	9.292,08	0,66%	6,34%	0,66%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	17.271.467,75	0,00	0,00	17.383.026,97	111.559,22	0,65%	6,44%	0,65%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.078.006,84	0,00	0,00	3.097.160,76	19.153,92	0,62%	1,92%	0,62%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.533.185,00	0,00	0,00	5.562.440,00	29.255,00	0,53%	0,10%	0,53%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	5.000.000,00	0,00	5.007.039,05	7.039,05	0,14%	1,15%	1,32%
Total Renda Variável					417.699,30	0,68%	4,72%	