

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)

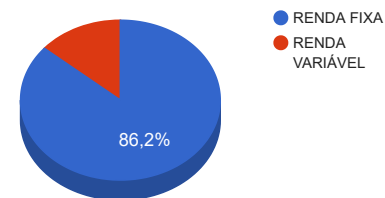
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	86.204.076,89	18,49%	943	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.505.409,55	3,33%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	93.208.004,02	20,00%	668	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	74.260.585,67	15,93%	924	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.462.927,39	0,31%	1.208	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	44.325.394,46	9,51%	966	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.108.218,10	11,61%	369	1,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.930.473,60	0,84%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.445.966,45	1,17%	1.372	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.288.258,72	1,78%	738	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	4.544.466,03	0,97%	76	2,56%	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	10.613.964,69	2,28%	74	1,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	24.464.403,90	5,25%	97	5,33%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	18.229.380,50	3,91%	89	2,31%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.504.784,03	0,32%	191	0,24%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	5.779.635,00	1,24%	729	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.157.937,43	1,11%	16.354	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	3.426.398,36	0,74%	955	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.184.836,78	0,68%	7.105	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	2.480.407,07	0,53%		0,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			466.125.528,64				

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

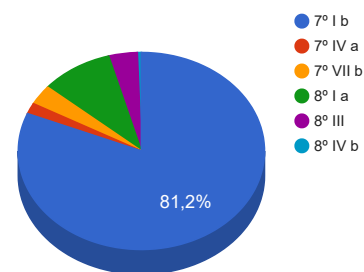
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	378.451.056,13	81,19%	15,00%	50,00%	90,00%	41.061.919,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	139.837.658,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.288.258,72	1,78%	5,00%	28,00%	35,00%	154.855.676,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	15.158.430,72	3,25%	1,00%	3,00%	5,00%	8.147.845,71
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	44.198.568,43	9,48%	2,00%	11,00%	15,00%	25.720.260,87
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	23.306.276,43
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	17.548.807,57	3,76%	1,00%	4,00%	10,00%	29.063.745,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.480.407,07	0,53%	0,00%	1,00%	5,00%	20.825.869,36
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	23.306.276,43
Total Carteira		466.125.528,64					

RENDA FIXA	401.897.745,57	86,22%
RENDA VARIÁVEL	64.227.783,07	13,78%

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 "	378.451.056,13	81,19%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	8.288.258,72	1,78%	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 "	15.158.430,72	3,25%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	44.198.568,43	9,48%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	17.548.807,57	3,76%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.480.407,07	0,53%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total	466.125.528,64	100,00%	24,00	215,00

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	430.627.562,31	92,38%	0,08%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.017.559,26	7,08%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.480.407,07	0,53%	0,12%

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,65%	31,99%	7,65%	20,61%	36,37%	50,74%	0,20%	2,793%	7,89%
IMA-B	3,36%	23,57%	5,89%	15,34%	26,74%	39,79%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	8,98%	2,32%	5,19%	10,43%	20,61%	0,20%	0,581%	1,31%
IMA-B 5	1,65%	12,09%	3,47%	7,74%	13,78%	24,36%	-	-	-
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,63%	7,75%	1,71%	3,57%	8,69%	20,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,29%	16,09%	4,59%	11,19%	17,59%	26,01%	0,20%	1,442%	3,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,52%	12,32%	3,29%	7,65%	14,34%	34,18%	0,20%	0,948%	2,07%
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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	5,02%	1,39%	2,96%	6,04%	12,77%	0,20%	0,008%	0,12%

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

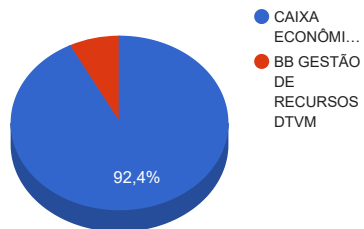
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,10%	2,60%	0,17%	0,50%	2,54%	7,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,71%	16,33%	3,73%	10,67%	18,32%	26,77%	0,002	1,122%	3,53%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,51%	11,19%	3,32%	6,84%	12,79%	24,85%	0,20%	0,881%	1,66%

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

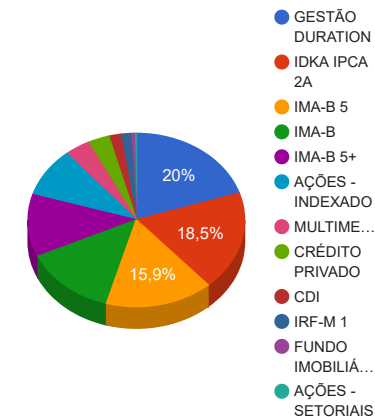
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	4,01%	18,73%	4,98%	11,30%	24,51%	25,41%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
IGC	2,54%	26,29%	6,80%	15,22%	28,11%	44,60%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2,80%	23,27%	6,44%	13,12%	25,46%	43,30%	1,00%	8,183%	11,04%
Ibovespa	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3,09%	7,18%	3,90%	5,52%	8,72%	-	1,60%	1,241%	2,66%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2,29%	21,43%	5,16%	10,99%	22,09%	42,76%	0,50%	8,331%	11,67%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,35%	6,72%	1,56%	4,57%	9,07%	-	1,60%	2,455%	1,29%
IBX-50	2,18%	20,18%	4,87%	10,15%	20,18%	41,48%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	2,19%	19,63%	4,87%	10,53%	19,06%	37,79%	0,70%	8,566%	12,01%
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	430.627.562,31	92,38%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.497.966,33	7,62%

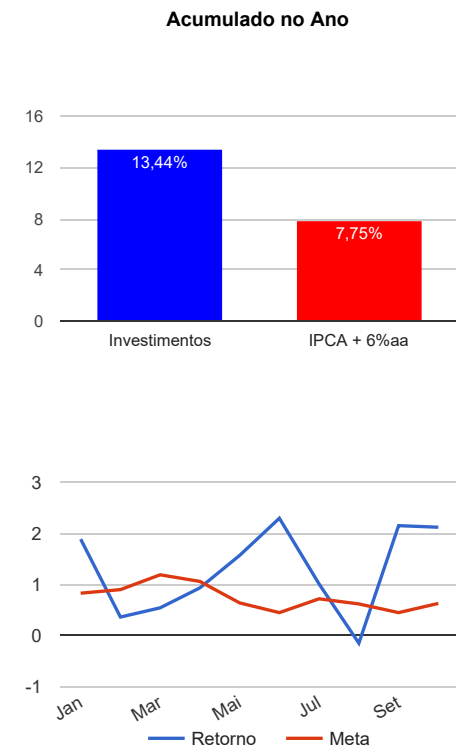


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	93.208.004,02	20,00%
IDKA IPCA 2A	86.204.076,89	18,49%
IMA-B 5	74.260.585,67	15,93%
IMA-B	63.761.277,61	13,68%
IMA-B 5+	54.108.218,10	11,61%
AÇÕES - INDEXADO	42.693.784,40	9,16%
MULTIMERCADO	17.548.807,57	3,76%
CRÉDITO PRIVADO	15.158.430,72	3,25%
CDI	8.288.258,72	1,78%
IRF-M 1	6.908.893,84	1,48%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.480.407,07	0,53%
AÇÕES - SETORIAIS	1.504.784,03	0,32%



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%
Agosto	442.078.386,06	5.563.459,70	4.123.183,97	442.864.075,25	-654.586,54	-0,15%	0,62%	-23,78%	2,53%
Setembro	442.864.075,25	4.490.117,74	3.279.400,00	453.627.311,89	9.552.518,90	2,15%	0,45%	481,71%	1,69%
Outubro	453.627.311,89	6.114.499,75	3.293.400,00	466.125.528,64	9.677.117,00	2,12%	0,63%	334,52%	1,98%
Acumulado no ano					54.270.500,61	13,44%	7,75%	173,44%	



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	51.706.411,63	0,00	0,00	54.108.218,10	2.401.806,47	4,65%	2,79%	4,65%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	42.898.858,88	0,00	0,00	44.325.394,46	1.426.535,58	3,33%	1,92%	3,33%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.442.741,55	0,00	0,00	4.544.466,03	101.724,48	2,29%	1,44%	2,29%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	91.640.625,99	0,00	0,00	93.208.004,02	1.567.378,03	1,71%	1,12%	1,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	73.062.933,48	0,00	0,00	74.260.585,67	1.197.652,19	1,64%	0,97%	1,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.273.913,50	0,00	0,00	15.505.409,55	231.496,05	1,52%	0,95%	1,52%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.455.964,88	0,00	0,00	10.613.964,69	157.999,81	1,51%	0,88%	1,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	85.117.503,74	0,00	0,00	86.204.076,89	1.086.573,15	1,28%	0,76%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.889.752,88	0,00	0,00	3.930.473,60	40.720,72	1,05%	0,58%	1,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.403.886,02	50.503,83	0,00	1.462.927,39	8.537,54	0,59%	0,15%	0,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.619.995,15	49.501,32	3.273.000,00	5.445.966,45	49.469,98	0,57%	0,15%	0,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.244.540,47	6.014.494,60	0,00	8.288.258,72	29.223,65	0,35%	0,01%	0,45%
Total Renda Fixa					8.299.117,65	2,11%	1,28%	

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(%)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.370.388,36	0,00	20.400,00	2.480.407,07	130.418,71	5,50%	-	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.606.235,00	0,00	0,00	5.779.635,00	173.400,00	3,09%	1,24%	3,09%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.463.864,97	0,00	0,00	1.504.784,03	40.919,06	2,80%	8,18%	2,80%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	23.915.773,27	0,00	0,00	24.464.403,90	548.630,63	2,29%	8,33%	2,29%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	17.838.503,86	0,00	0,00	18.229.380,50	390.876,64	2,19%	8,57%	2,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.147.350,78	0,00	0,00	3.184.836,78	37.486,00	1,19%	2,46%	1,19%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.113.526,29	0,00	0,00	5.157.937,43	44.411,14	0,87%	1,48%	0,87%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.414.541,19	0,00	0,00	3.426.398,36	11.857,17	0,35%	2,46%	0,35%
Total Renda Variável					1.377.999,35	2,19%	6,53%	