

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)

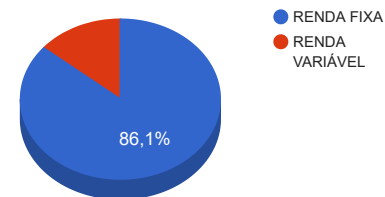
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			6.010.574,59	12,31%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.764.447,79	5,66%	879	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	864.954,23	1,77%	21	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.339.468,78	6,84%	1.372	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.329.691,26	10,92%	943	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.922.090,47	12,13%	924	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.402.536,53	6,97%	564	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.711.588,74	15,80%	668	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.280.231,19	6,72%	116	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	3.345.912,03	6,85%	522	0,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	41.494,35	0,09%	326	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15 du	Não há	1.011.731,35	2,07%	40	1,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	488.552,84	1,00%	215	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.128.691,88	2,31%	27.847	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	4.171.424,93	8,55%	211	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
		Total	48.813.390,96				

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

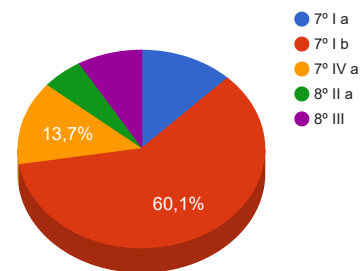
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	6.010.574,59	12,31%	0,00%	13,00%	20,00%	3.752.103,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	29.334.777,80	60,10%	15,00%	35,00%	70,00%	4.834.595,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	55,00%	26.847.365,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.667.637,57	13,66%	10,00%	25,00%	40,00%	12.857.718,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.440.669,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.440.669,55
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.628.976,07	5,39%	0,00%	5,00%	20,00%	7.133.702,12
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.171.424,93	8,55%	7,00%	10,00%	10,00%	709.914,17
Total Carteira		48.813.390,96					

RENDA FIXA	42.012.989,96	86,07%
RENDA VARIÁVEL	6.800.401,00	13,93%

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 " a "	6.010.574,59	12,31%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	29.334.777,80	60,10%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	55,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.667.637,57	13,66%	10,00%	40,00%
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 "	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 "	2.628.976,07	5,39%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.171.424,93	8,55%	7,00%	10,00%
Total	48.813.390,96	100,00%	32,00	235,00

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)

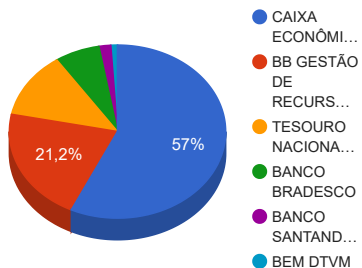
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.830.668,86	57,01%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.338.409,25	21,18%	0,00%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	6.010.574,59	12,31%	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.768.784,03	7,72%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	864.954,23	1,77%	0,00%

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

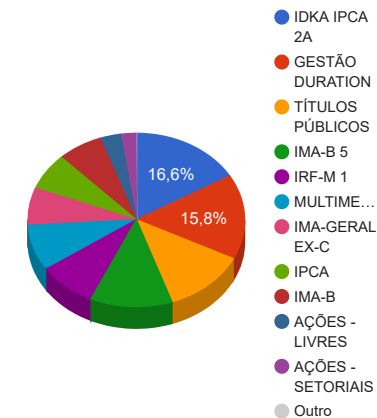
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (outubro / 2019) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.830.668,86	57,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.338.409,25	21,18%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	6.010.574,59	12,31%
BANCO BRADESCO	3.280.231,19	6,72%
BANCO SANTANDER	864.954,23	1,77%
BEM DTVM	488.552,84	1,00%



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	8.094.139,05	16,58%
GESTÃO DURATION	7.711.588,74	15,80%
TÍTULOS PÚBLICOS	6.010.574,59	12,31%
IMA-B 5	5.922.090,47	12,13%
IRF-M 1	4.204.423,01	8,61%
MULTIMERCADO	4.171.424,93	8,55%
IMA-GERAL EX-C	3.402.536,53	6,97%
IPCA	3.345.912,03	6,85%
IMA-B	3.280.231,19	6,72%
AÇÕES - LIVRES	1.500.284,19	3,07%
AÇÕES - SETORIAIS	1.128.691,88	2,31%
CDI	41.494,35	0,09%

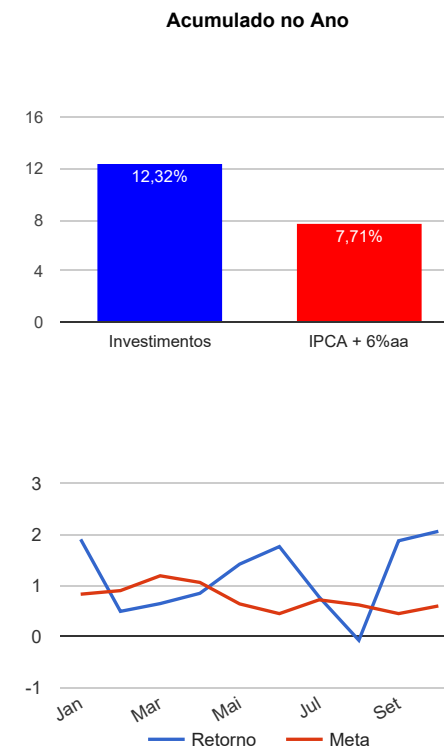


Carteira de Títulos Públicos - base (outubro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	3.854,548814	743.672,41	1.927.274,41
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.854,548814	403.538,02	1.040.728,18
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	4.829,479369	695.984,05	3.042.572,00

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	39.753.444,62	1.968.013,87	338.080,69	42.170.818,62	787.440,82	1,90%	0,83%	228,80%	0,81%
Fevereiro	42.170.818,62	3.793.921,55	4.078.754,57	42.094.410,87	208.425,27	0,49%	0,90%	55,19%	0,96%
Março	42.094.410,87	3.710.901,95	4.111.571,20	41.965.831,55	272.089,93	0,65%	1,19%	54,15%	1,71%
Abril	41.965.831,55	7.488.071,40	7.315.780,34	42.495.255,99	357.133,38	0,85%	1,06%	79,99%	1,07%
Mai	42.495.255,99	4.413.362,77	4.193.309,03	43.321.011,13	605.701,40	1,42%	0,64%	221,34%	0,95%
Junho	43.321.011,13	8.416.007,56	6.129.636,18	46.410.465,41	803.082,90	1,76%	0,45%	391,01%	1,19%
Julho	46.410.465,41	2.381.072,12	1.607.452,22	47.549.888,82	365.803,51	0,78%	0,72%	107,04%	0,75%
Agosto	47.549.888,82	5.239.154,61	5.864.851,74	46.890.166,86	-34.024,83	-0,07%	0,62%	-11,53%	1,60%
Setembro	46.890.166,86	3.214.514,76	3.667.288,11	47.316.417,94	879.024,43	1,87%	0,45%	419,80%	1,23%
Outubro	47.316.417,94	5.382.849,40	4.871.054,64	48.813.390,96	985.178,26	2,06%	0,60%	345,31%	1,50%
Acumulado no ano					5.229.855,07	12,32%	7,71%	159,74%	



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(%)	
TÍTULOS PÚBLICOS	5.806.345,90	0,00	0,00	6.010.574,59	204.228,69	3,52%	-	-	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.169.993,44	0,00	0,00	3.280.231,19	110.237,75	3,48%	1,99%	3,48%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.342.409,21	0,00	0,00	3.402.536,53	60.127,32	1,80%	0,93%	1,80%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.581.911,31	0,00	0,00	7.711.588,74	129.677,43	1,71%	1,12%	1,71%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.826.580,79	0,00	0,00	5.922.090,47	95.509,68	1,64%	0,97%	1,64%	
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	3.292.157,99	0,00	0,00	3.345.912,03	53.754,04	1,63%	0,98%	1,63%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.262.512,29	0,00	0,00	5.329.691,26	67.178,97	1,28%	0,76%	1,28%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.730.622,03	0,00	0,00	2.764.447,79	33.825,76	1,24%	0,82%	1,24%	
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	941.553,11	0,00	81.639,02	864.954,23	5.040,14	0,54%	0,15%	0,58%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.707.886,11	874.162,41	1.260.000,00	3.339.468,78	17.420,26	0,38%	0,15%	0,61%	
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	458.658,78	0,00	459.223,25	0,00	564,47	0,12%	0,15%	0,60%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	32.254,11	2.096.957,29	2.088.638,81	41.494,35	921,76	0,04%	0,00%	0,40%	
Total Renda Fixa						778.486,27	1,85%	0,95%	

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 PETROBRAS FI AÇÕES	0,00	981.553,56	0,00	1.128.691,88	147.138,32	14,99%	11,94%	8,33%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,00	459.223,25	0,00	488.552,84	29.329,59	6,39%	7,46%	3,47%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	970.952,89	0,00	1.011.731,35	40.778,46	4,20%	7,61%	2,53%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.139.580,27	0,00	0,00	4.171.424,93	31.844,66	0,77%	1,21%	0,77%
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	1.023.952,60	0,00	981.553,56	0,00	-42.399,04	-4,14%	11,98%	8,27%
Total Renda Variável					206.691,99	3,13%	4,39%	

