

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

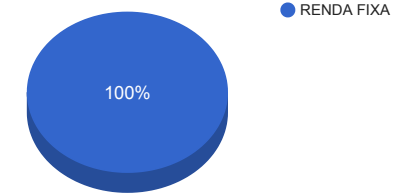
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	63.104.419,86	48,97%	616	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	1.139.367,88	0,88%	31	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.566.667,16	1,99%	688	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.128.919,22	0,88%	1.250	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.608.109,98	5,90%	334	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.907.700,06	6,91%	220	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.369.044,97	11,93%	920	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.852.738,87	2,21%	744	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.064.914,24	13,24%	821	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.226.802,44	4,83%	244	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.906.086,51	2,25%	719	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
Total para cálculo dos limites da Resolução			128.874.771,19				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			18.021,58				Artigo 6º
Total			128.892.792,77				

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

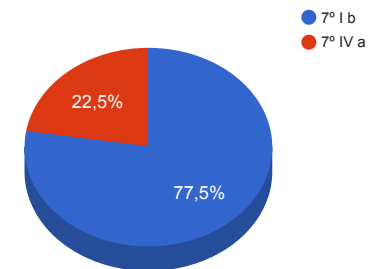
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	99.824.229,13	77,46%	20,00%	35,00%	80,00%	3.275.587,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%	64.437.385,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	29.050.542,06	22,54%	0,00%	20,00%	30,00%	9.611.889,30
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	12.887.477,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	6.443.738,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	25.774.954,24
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	12.887.477,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.443.738,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.443.738,56
Total Carteira		128.874.771,19					

RENDA FIXA	128.892.792,77	100,01%
------------	----------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	99.824.229,13	77,46%	20,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	29.050.542,06	22,54%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
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%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	128.874.771,19	100,00%	20,00	223,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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	79.925.001,94	62,02%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.949.769,25	37,98%	0,01%

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

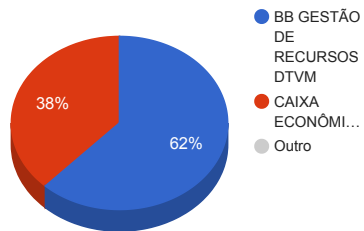
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,06%	21,12%	12,50%	21,12%	40,78%	49,39%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,00%	20,79%	12,31%	20,79%	39,92%	48,15%	0,20%	3,080%	11,62%
IMA-B	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	15,04%	9,08%	15,04%	28,39%	38,55%	0,20%	2,331%	7,63%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	15,00%	9,04%	15,00%	28,48%	38,78%	0,30%	2,318%	7,64%
IRF-M	2,16%	6,98%	4,59%	6,98%	15,72%	26,07%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,14%	6,86%	4,54%	6,86%	15,51%	25,56%	0,20%	1,189%	3,82%
IMA Geral	2,00%	7,90%	4,78%	7,90%	15,90%	25,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,92%	7,58%	4,61%	7,58%	15,44%	24,63%	0,20%	1,018%	3,44%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,98%	3,39%	5,98%	12,17%	23,08%	0,20%	0,954%	1,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	2,94%	1,47%	2,94%	6,09%	15,57%	0,20%	0,000%	0,16%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,10%	0,171%	0,49%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	3,01%	1,50%	3,01%	6,19%	14,07%	0,20%	0,003%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	3,01%	1,50%	3,01%	6,17%	13,82%	0,20%	0,003%	0,12%

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

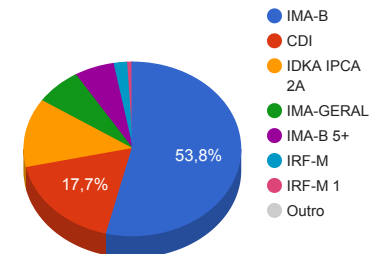
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,53%	1,27%	2,53%	5,19%	11,74%	1,00%	0,004%	0,10%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	79.925.001,94	62,02%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.949.769,25	37,98%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	18.021,58	0,01%



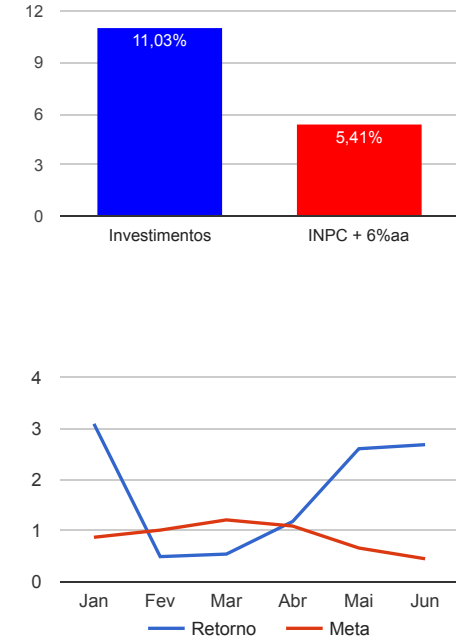
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	69.331.222,30	53,80%
CDI	22.823.739,62	17,71%
IDKA IPCA 2A	16.508.412,85	12,81%
IMA-GERAL	8.907.700,06	6,91%
IMA-B 5+	7.608.109,98	5,90%
IRF-M	2.566.667,16	1,99%
IRF-M 1	1.128.919,22	0,88%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	18.021,58	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	114.139.448,00	502.349,07	1.627.142,47	116.539.906,50	3.525.251,90	3,09%	0,87%	354,26%	1,25%
Fevereiro	116.539.906,50	1.624.160,32	2.133.270,81	116.603.700,00	572.903,99	0,49%	1,01%	48,87%	1,71%
Março	116.603.700,00	1.773.138,19	1.927.296,36	117.080.951,25	631.409,42	0,54%	1,21%	44,62%	2,83%
Abril	117.080.951,25	6.987.953,66	3.133.450,77	122.360.786,10	1.425.331,96	1,18%	1,09%	108,16%	1,13%
Mai	122.360.786,10	3.087.792,09	3.144.992,37	125.487.290,90	3.183.705,08	2,60%	0,66%	393,78%	1,48%
Junho	125.487.290,90	1.205.490,04	1.183.738,02	128.874.771,19	3.365.728,27	2,68%	0,45%	595,47%	1,65%
Acumulado no ano					12.704.330,62	11,03%	5,41%	203,86%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	7.245.562,86	0,00	0,00	7.608.109,98	362.547,12	5,00%	3,08%	5,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.844.711,78	0,00	0,00	63.104.419,86	2.259.708,08	3,71%	2,33%	3,71%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.004.274,26	0,00	0,00	6.226.802,44	222.528,18	3,71%	2,32%	3,71%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.512.890,15	0,00	0,00	2.566.667,16	53.777,01	2,14%	1,19%	2,14%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.739.985,53	0,00	0,00	8.907.700,06	167.714,53	1,92%	1,02%	1,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.183.965,51	0,00	0,00	15.369.044,97	185.079,46	1,22%	0,95%	1,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.122.492,73	0,00	0,00	1.128.919,22	6.426,49	0,57%	0,17%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.839.750,61	0,00	0,00	2.852.738,87	12.988,26	0,46%	0,00%	0,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.134.280,31	0,00	0,00	1.139.367,88	5.087,57	0,45%	0,00%	0,45%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.789.344,56	732.000,00	534.400,00	17.064.914,24	77.969,68	0,44%	0,00%	0,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.070.032,60	473.490,04	649.338,02	2.906.086,51	11.901,89	0,34%	0,00%	0,39%
Total Renda Fixa					3.365.728,27	2,68%	1,65%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	57.849.799,82	0,00	0,00	63.104.419,86	5.254.620,04	9,08%	9,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.773.932,02	0,00	0,00	7.608.109,98	834.177,96	12,31%	12,31%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.710.306,56	0,00	0,00	6.226.802,44	516.495,88	9,04%	9,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.865.401,19	0,00	0,00	15.369.044,97	503.643,78	3,39%	3,39%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.514.973,40	0,00	0,00	8.907.700,06	392.726,66	4,61%	4,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.249.348,74	7.091.900,00	3.524.400,00	17.064.914,24	248.065,50	1,38%	1,50%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.455.286,78	0,00	0,00	2.566.667,16	111.380,38	4,54%	4,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.810.534,24	0,00	0,00	2.852.738,87	42.204,63	1,50%	1,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.618.773,55	4.189.335,79	3.937.781,16	2.906.086,51	35.758,33	0,86%	1,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.109.759,94	0,00	0,00	1.128.919,22	19.159,28	1,73%	1,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.122.835,01	0,00	0,00	1.139.367,88	16.532,87	1,47%	1,47%
Total Renda Fixa					7.974.765,31	6,60%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.854.817,16	0,00	0,00	63.104.419,86	8.249.602,70	15,04%	15,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.298.799,39	0,00	0,00	7.608.109,98	1.309.310,59	20,79%	20,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.502.225,69	0,00	0,00	15.369.044,97	866.819,28	5,98%	5,98%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.414.453,38	0,00	0,00	6.226.802,44	812.349,06	15,00%	15,00%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.280.040,88	0,00	0,00	8.907.700,06	627.659,18	7,58%	7,58%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.854.898,06	7.091.900,00	6.345.035,00	17.064.914,24	463.151,18	2,86%	3,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.401.900,43	0,00	0,00	2.566.667,16	164.766,73	6,86%	6,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.769.459,54	0,00	0,00	2.852.738,87	83.279,33	3,01%	3,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.562.235,38	8.088.983,37	6.804.855,80	2.906.086,51	59.723,56	1,69%	2,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.093.795,52	0,00	0,00	1.128.919,22	35.123,70	3,21%	3,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.106.822,57	0,00	0,00	1.139.367,88	32.545,31	2,94%	2,94%
Total Renda Fixa					12.704.330,62	11,03%	