

## Relatório Analítico dos Inv em al



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 (abril / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.002.726,54	2,87%	466	0,08%	Ar
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	226.967,05	0,13%	106	0,04%	Ar
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	19.346.525,97	11,09%	1.449	0,12%	Ar
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.712.991,62	6,14%	805	0,12%	Ar
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.007.273,50	0,58%	256	0,06%	Ar
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	5.673.214,63	3,25%	107	0,57%	Ar
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	36.984.827,94	21,20%	852	0,43%	Ar
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.126.260,28	2,94%	201	0,36%	Ar
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.763.204,97	1,58%	266	0,14%	Ar
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.832.770,04	1,05%	502	0,05%	Ar
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.322.555,21	3,62%	1.248	0,06%	Ar
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.459.433,58	4,85%	552	0,17%	Ar
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.560.715,47	1,47%	689	0,05%	Ar
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	21.833.490,56	12,52%	838	0,30%	Ar
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.322.074,79	1,90%	811	0,04%	Ar
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.901.047,14	3,96%	73	0,53%	Ar
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.169.200,22	1,24%	45	1,17%	Ar
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.052.448,17	1,75%	324	0,55%	Art
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.648.188,60	0,94%	91	0,34%	Art
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	1.599.269,29	0,92%	216	0,05%	Art
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.546.453,04	8,34%	454	0,31%	Art
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.374.206,51	1,36%	150	0,51%	Ar

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2019)

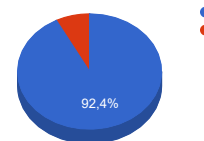
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	901.580,73	0,52%	231	0,15%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.272.899,10	1,88%	4.359	0,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.184.472,41	1,25%	955	0,46%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.596.042,25	2,64%	4.480	0,62%
		<b>TOTAL -</b>	<b>174.420.839,61</b>			

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

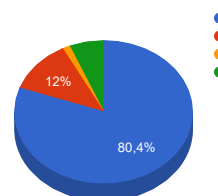
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	140.245.279,51	80,41%	15,00%	40,00%	100,00%	34.175.560,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	104.652.503,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	20.846.359,10	11,95%	0,00%	29,00%	40,00%	48.921.976,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	8.721.041,98
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.374.206,51	1,36%	0,00%	5,00%	20,00%	32.509.961,41
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	34.884.167,92
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.954.994,49	6,28%	0,00%	5,00%	10,00%	6.487.089,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	8.721.041,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	8.721.041,98
<b>Total Carteira</b>		<b>174.420.839,61</b>					

RENDA FIXA	161.091.638,61	92,36%
RENDA VARIÁVEL	13.329.201,00	7,64%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	140.245.279,51	80,41%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	20.846.359,10	11,95%	0,00%	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%	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 I, Alínea " a "	2.374.206,51	1,36%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	10.954.994,49	6,28%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>174.420.839,61</b>	<b>100,00%</b>	<b>15,00</b>	<b>300,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 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	118.482.462,31	67,93%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	52.690.919,41	30,21%	0,00%
Bradesco Asset Management	1.648.188,60	0,94%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	1.599.269,29	0,92%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IMA-B 5+	1,79%	9,59%	7,66%	13,41%	20,14%	29,29%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	9,44%	2,73%	13,07%	19,64%	31,89%	0,20%	2,399%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,75%	9,40%	2,64%	13,17%	19,79%	31,72%	0,20%	2,416%
IMA-B	1,51%	7,13%	5,54%	9,94%	15,59%	25,92%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	7,04%	2,57%	9,75%	15,27%	27,55%	0,20%	1,634%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	7,09%	2,59%	9,82%	15,40%	27,74%	0,20%	1,617%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	2,63%	0,20%	4,60%	5,87%	12,95%	0,20%	1,194%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	0,39%	-0,65%	1,43%	2,11%	8,65%	0,20%	0,387%
IDKA IPCA 5 Anos	1,22%	5,42%	4,15%	7,79%	12,46%	26,13%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	4,53%	2,55%	6,54%	10,47%	24,37%	0,20%	0,933%
IMA-B 5	1,11%	4,03%	2,90%	5,65%	9,94%	22,26%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	3,94%	2,39%	5,48%	9,71%	22,29%	0,20%	0,640%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	3,95%	2,38%	5,53%	9,73%	22,29%	0,20%	0,637%
IDKA IPCA 2 Anos	1,03%	3,54%	2,48%	5,04%	9,41%	22,74%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,62%	2,38%	5,01%	9,10%	21,55%	0,20%	0,564%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	3,60%	2,30%	4,94%	9,02%	21,57%	0,20%	0,565%
IMA Geral	0,86%	3,86%	2,98%	5,88%	10,10%	21,32%	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	3,68%	1,75%	5,69%	9,67%	21,19%	0,20%	0,715%
IMA Geral ex-C	0,84%	3,78%	2,92%	5,84%	9,88%	21,13%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	3,83%	1,79%	5,84%	10,00%	21,16%	0,30%	0,842%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	3,70%	1,77%	5,69%	9,65%	21,15%	0,20%	0,714%
IRF-M	0,61%	2,90%	2,28%	5,48%	9,30%	23,19%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	2,82%	1,44%	5,40%	9,10%	22,73%	0,20%	0,814%
IPCA	0,57%	2,09%	1,51%	2,04%	4,94%	7,38%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	5,11%	2,17%	6,91%	9,82%	20,46%	0,002	1,412%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,76%	3,67%	1,68%	5,79%	9,47%	-	0,40%	0,725%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,66%	3,81%	1,40%	6,15%	8,41%	19,26%	0,40%	0,549%
CDI	0,52%	2,04%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	1,76%	1,28%	2,63%	5,46%	13,09%	0,80%	0,000%
IRF-M 1	0,50%	2,03%	1,53%	3,19%	6,68%	16,65%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	1,98%	1,40%	3,07%	6,52%	15,85%	0,20%	0,082%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,97%	1,38%	3,05%	6,47%	15,74%	0,10%	0,087%

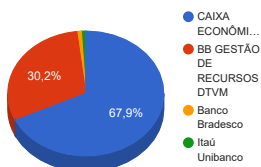


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2019)

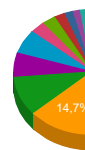
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IGC	1,20%	9,61%	8,31%	12,07%	13,83%	43,40%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,98%	-1,30%	10,91%	15,31%	43,50%	1,00%	7,815%
Ibovespa	0,98%	9,63%	8,56%	10,90%	11,89%	46,83%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,48%	2,06%	1,06%	4,30%	-	-	1,60%	0,488%
CDI	0,52%	2,04%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,19%	5,41%	1,67%	7,29%	10,78%	23,95%	0,50%	1,516%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	2,66%	1,83%	3,74%	7,03%	18,36%	0,60%	0,300%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,74%	4,05%	0,65%	4,90%	7,43%	21,92%	1,00%	2,242%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	118.482.462,31	67,93%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	52.690.919,41	30,21%
Banco Bradesco	1.648.188,60	0,94%
Itaú Unibanco	1.599.269,29	0,92%



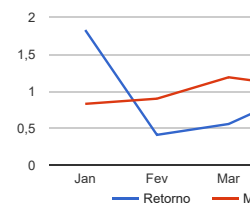
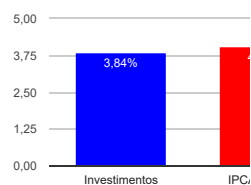
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	58.818.318,50	33,72%
IMA-B	26.073.472,34	14,95%
IRF-M 1	25.669.081,18	14,72%
GESTÃO DURATION	17.793.910,93	10,20%
MULTIMERCADO	10.954.994,49	6,28%
IMA-B 5	10.828.059,46	6,21%
IMA-GERAL	5.353.227,33	3,07%
IMA-GERAL EX-C	5.002.726,54	2,87%
IMA-B 5+	3.770.478,47	2,16%
CDI	3.052.448,17	1,75%
IRF-M	2.560.715,47	1,47%
AÇÕES - SETORIAIS	2.374.206,51	1,36%
IDKA IPCA 5A	2.169.200,22	1,24%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	163.573.881,49	1.268.699,00	89.778,36	167.767.882,90	3.015.080,77	1,83%	0,83%	220,06%	0,84%
Fevereiro	167.767.882,90	16.288.526,61	13.896.797,26	170.856.662,52	697.050,27	0,41%	0,90%	45,74%	1,48%
Março	170.856.662,52	1.048.654,84	465.622,89	172.394.410,35	954.715,88	0,56%	1,19%	46,66%	1,90%
Abril	172.394.410,35	1.298.472,26	993.284,01	174.420.839,61	1.721.241,01	1,00%	1,06%	94,07%	0,91%
Acumulado no ano					6.388.087,93	3,84%	4,04%	95,09%	

Acumulado no An



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.715.308,56	0,00	0,00	2.763.204,97	47.896,41	1,76%	2
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	989.958,43	0,00	0,00	1.007.273,50	17.315,07	1,75%	2
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.334.753,63	0,00	0,00	8.459.433,58	124.679,95	1,50%	1
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.555.833,64	0,00	0,00	10.712.991,62	157.157,98	1,49%	1
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.142.437,75	0,00	0,00	2.169.200,22	26.762,47	1,25%	0
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.820.338,19	0,00	0,00	6.901.047,14	80.708,95	1,18%	1
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.594.922,41	0,00	0,00	21.833.490,56	238.568,15	1,10%	0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.813.094,74	0,00	0,00	1.832.770,04	19.675,30	1,09%	0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.286.641,15	0,00	0,00	3.322.074,79	35.433,64	1,08%	0
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	13.523.578,54	869.068,26	0,00	14.546.453,04	153.806,24	1,07%	1
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.594.048,03	0,00	0,00	36.984.827,94	390.779,91	1,07%	0
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.620.257,09	0,00	0,00	5.673.214,63	52.957,54	0,94%	0
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.959.586,32	0,00	0,00	5.002.726,54	43.140,22	0,87%	0
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	225.124,38	0,00	0,00	226.967,05	1.842,67	0,82%	0
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.084.745,33	0,00	0,00	5.126.260,28	41.514,95	0,82%	0
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.635.728,22	0,00	0,00	1.648.188,60	12.460,38	0,76%	0
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.588.761,95	0,00	0,00	1.599.269,29	10.507,34	0,66%	0
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.545.719,59	0,00	0,00	2.560.715,47	14.995,88	0,59%	0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.249.992,12	0,00	0,00	19.346.525,97	96.533,85	0,50%	0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.291.204,84	0,00	0,00	6.322.555,21	31.350,37	0,50%	0
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.599.469,91	429.404,00	993.284,01	3.052.448,17	16.858,27	0,42%	0
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.614.945,54</b>	<b>1,01%</b>	<b>0</b>

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.234.271,31	0,00	0,00	3.272.899,10	38.627,79	1,19%	1
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	894.538,43	0,00	0,00	901.580,73	7.042,30	0,79%	0
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.562.504,64	0,00	0,00	4.596.042,25	33.537,61	0,74%	2
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.357.471,73	0,00	0,00	2.374.206,51	16.734,78	0,71%	7
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.174.119,42	0,00	0,00	2.184.472,41	10.352,99	0,48%	0
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>106.295,47</b>	<b>0,80%</b>	<b>2</b>