

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2019)

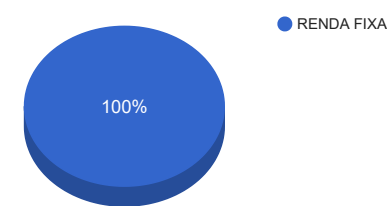
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.552.628,83	10,87%	313	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.086.264,11	3,32%	913	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	444.437,40	1,36%	17	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.889.419,05	5,78%	963	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.544.779,74	16,96%	937	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.661.629,07	17,32%	1.389	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.472.925,50	7,56%	104	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	1.380.410,00	4,22%	96	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.262.060,43	3,86%	226	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	D+0	Não há	1.859.049,26	5,69%	100	0,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.021.096,41	6,18%	129	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.519.467,86	16,88%	695	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
Total			32.694.167,66				

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

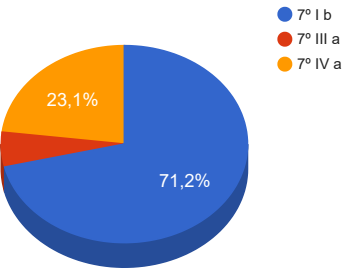
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	23.294.554,13	71,25%	20,00%	50,00%	70,00%	-408.636,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.859.049,26	5,69%	15,00%	20,00%	60,00%	17.757.451,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.540.564,27	23,06%	20,00%	30,00%	40,00%	5.537.102,79
Total Carteira		32.694.167,66					

RENTA FIXA	32.694.167,66	100,00%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	23.294.554,13	71,25%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.859.049,26	5,69%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.540.564,27	23,06%	20,00%	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 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	32.694.167,66	100,00%	55,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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	21.914.144,13	67,03%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.519.467,86	16,88%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	5.260.555,67	16,09%	0,05%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,86%	19,55%	3,77%	13,27%	31,37%	34,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,85%	19,37%	3,72%	13,12%	31,16%	34,16%	0,20%	1,975%	7,37%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	8,61%	0,74%	7,49%	17,51%	14,70%	0,20%	1,465%	7,91%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	8,62%	0,74%	7,49%	17,52%	14,71%	0,20%	1,465%	7,90%

IRF-M 1+	1,87%	11,89%	3,27%	9,07%	20,81%	27,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,85%	11,58%	3,21%	8,89%	20,82%	26,68%	0,20%	1,217%	4,71%

IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,72%	10,08%	2,72%	7,04%	15,21%	22,44%	0,20%	1,012%	2,86%

IDKA IPCA 2 Anos	1,60%	9,13%	2,72%	6,49%	12,85%	22,46%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	8,58%	2,46%	5,93%	12,28%	20,88%	0,20%	0,821%	1,92%

IMA Geral	1,46%	10,72%	2,61%	7,52%	16,78%	23,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	10,29%	2,52%	7,25%	16,39%	22,07%	0,20%	0,808%	3,19%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL...	1,39%	9,99%	2,44%	7,09%	15,73%	21,80%	0,20%	0,761%	2,98%

IRF-M 1	0,64%	5,31%	1,92%	3,72%	7,44%	14,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,63%	5,15%	1,86%	3,63%	7,28%	14,32%	0,20%	0,116%	0,46%

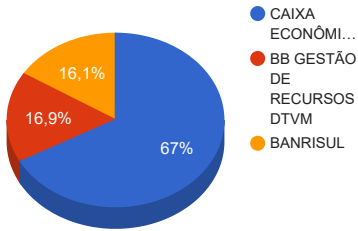
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,45%	4,53%	1,50%	3,02%	6,10%	12,97%	0,15%	0,007%	0,12%

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

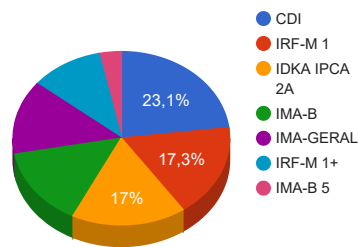
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,45%	4,55%	1,50%	3,02%	6,11%	13,21%	0,20%	0,008%	0,12%
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,57%	1,54%	-0,78%	1,90%	3,67%	8,68%	0,15%	0,039%	4,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.914.144,13	67,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.519.467,86	16,88%
BANRISUL	5.260.555,67	16,09%



Sub-segmento	Valor	%
CDI	7.540.564,27	23,06%
IRF-M 1	5.661.629,07	17,32%
IDKA IPCA 2A	5.544.779,74	16,96%
IMA-B	4.806.781,95	14,70%
IMA-GERAL	4.501.519,69	13,77%
IRF-M 1+	3.552.628,83	10,87%
IMA-B 5	1.086.264,11	3,32%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	30.280.702,91	41.736,73	136.121,44	30.592.752,29	406.434,09	1,34%	0,83%	161,40%	0,59%
Fevereiro	30.592.752,29	247.361,33	143.246,28	30.724.898,15	28.030,81	0,09%	0,90%	10,20%	1,18%
Março	30.724.898,15	133.404,90	145.846,28	30.892.854,89	180.398,12	0,59%	1,19%	49,19%	1,07%
Abril	30.892.854,89	135.474,53	145.846,28	31.131.462,51	248.979,37	0,81%	1,06%	76,07%	0,52%
Mai	31.131.462,51	1.107.825,82	1.120.180,76	31.526.260,68	407.153,11	1,31%	0,64%	204,14%	0,64%
Junho	31.526.260,68	134.717,38	146.846,28	31.966.174,89	452.043,11	1,43%	0,45%	318,40%	0,83%
Julho	31.966.174,89	135.331,23	141.596,28	32.231.834,67	271.924,83	0,85%	0,72%	117,45%	0,49%
Agosto	32.231.834,67	283.349,65	279.282,26	32.207.579,36	-28.322,70	-0,09%	0,62%	-14,16%	1,13%
Setembro	32.207.579,36	230.387,74	140.846,28	32.694.167,66	397.046,84	1,23%	0,45%	275,29%	0,65%
Acumulado no ano					2.363.687,58	7,81%	7,07%	110,37%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.837.043,40	0,00	0,00	1.889.419,05	52.375,65	2,85%	1,98%	2,85%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.419.819,50	0,00	0,00	2.472.925,50	53.106,00	2,19%	1,47%	2,19%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	434.894,40	0,00	0,00	444.437,40	9.543,00	2,19%	1,47%	2,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.487.932,22	0,00	0,00	3.552.628,83	64.696,61	1,85%	1,22%	1,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.067.895,00	0,00	0,00	1.086.264,11	18.369,11	1,72%	1,01%	1,72%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.247.915,90	0,00	3.846,28	1.262.060,43	17.990,81	1,44%	0,81%	1,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.466.906,98	0,00	0,00	5.544.779,74	77.872,76	1,42%	0,82%	1,42%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	1.739.565,23	230.387,74	137.000,00	1.859.049,26	26.096,29	1,32%	0,76%	1,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.626.365,39	0,00	0,00	5.661.629,07	35.263,68	0,63%	0,12%	0,63%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.372.540,00	0,00	0,00	1.380.410,00	7.870,00	0,57%	0,04%	0,57%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	2.011.992,37	0,00	0,00	2.021.096,41	9.104,04	0,45%	0,01%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.494.708,97	0,00	0,00	5.519.467,86	24.758,89	0,45%	0,01%	0,45%
Total Renda Fixa					397.046,84	1,23%	0,65%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.411.794,98	0,00	0,00	5.544.779,74	132.984,76	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.442.264,21	0,00	0,00	3.552.628,83	110.364,62	3,21%	3,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.488.658,28	70.151,37	0,00	5.661.629,07	102.819,42	1,86%	1,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.437.898,12	0,00	0,00	5.519.467,86	81.569,74	1,50%	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.821.645,31	0,00	0,00	1.889.419,05	67.773,74	3,72%	3,72%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	1.784.028,35	578.917,25	548.500,00	1.859.049,26	44.603,66	2,30%	2,44%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.244.075,38	0,00	13.224,82	1.262.060,43	31.209,87	2,52%	2,52%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	1.991.149,60	0,00	0,00	2.021.096,41	29.946,81	1,50%	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.057.505,66	0,00	0,00	1.086.264,11	28.758,45	2,72%	2,72%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.454.757,50	0,00	0,00	2.472.925,50	18.168,00	0,74%	0,74%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	441.157,50	0,00	0,00	444.437,40	3.279,90	0,74%	0,74%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.391.240,00	0,00	0,00	1.380.410,00	-10.830,00	-0,78%	-0,78%
Total Renda Fixa					640.648,97	2,00%	