

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	10.340.164,50	8,59%	686	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	29.634.762,83	24,63%	914	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.685.425,02	5,56%	790	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.196.978,13	3,49%	1.128	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.526.169,18	3,76%	577	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	86.115,48	0,07%	48	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	21.695.405,27	18,03%	793	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.987.809,00	19,10%	1.188	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.392.099,52	1,16%	1.116	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.017.726,97	14,14%	989	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.618.078,67	1,34%	28.374	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	159.830,31	0,13%	94	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			120.340.564,88				



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	80,97%	97.439.755,38
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100.152.829,41	83,22%	30,00%	53,00%	95,00%	14.170.707,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	18.409.826,49	15,30%	14,00%	14,45%	60,00%	53.794.512,44
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	24.068.112,98
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.017.028,24
Total Renda Fixa	100,00%	118.562.655,90	98,52%	44,00%	92,45%	260,97%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	1.618.078,67	1,34%	1,10%	1,45%	20,00%	22.450.034,31
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	159.830,31	0,13%	0,05%	0,10%	10,00%	11.874.226,18
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	1.777.908,98	1,48%	1,15%	1,55%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	12.034.056,49
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	61.700.941,24	51,27	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.639.623,64	48,73	-

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	80,97
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100.152.829,41	83,22	30,00	95,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	18.409.826,49	15,30	14,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	1.618.078,67	1,34	1,10	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	159.830,31	0,13	0,05	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,77%	8,66%	2,75%	5,42%	11,80%	22,33%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	8,36%	2,73%	5,26%	11,57%	21,91%	0,92%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,15%	9,05%	3,44%	6,81%	13,74%	24,03%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	8,82%	3,37%	6,66%	13,40%	23,37%	0,18%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	8,92%	3,38%	6,69%	13,51%	23,50%	0,18%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,61%	8,75%	2,66%	5,76%	11,97%	23,03%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	8,63%	2,58%	5,68%	11,73%	22,46%	0,95%	0,02%
IRF-M (Benchmark)	0,76%	11,43%	3,81%	9,56%	14,96%	22,06%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	11,10%	3,63%	9,30%	14,47%	21,30%	1,05%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	10,75%	3,67%	8,97%	14,02%	22,87%	0,10%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	8,81%	3,35%	6,69%	13,54%	25,45%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,24%	8,97%	3,54%	6,94%	13,76%	25,76%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,23%	3,23%	0,27%	1,83%	4,61%	13,74%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	8,68%	3,25%	6,54%	13,28%	27,76%	0,00%	0,00%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,63%	9,92%	3,67%	7,75%	13,76%	23,41%	0,58%	0,01%

