

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2019)

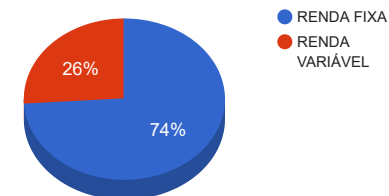
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.411.571,03	3,50%	962	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.613.783,73	8,41%	915	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.095.983,24	9,59%	875	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.003.260,49	7,93%	605	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.887.979,57	1,50%	1.390	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.577.230,84	5,21%	940	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	22.231.663,69	17,62%	630	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.908.520,87	2,31%	1.214	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	13.224.515,20	10,48%	136	1,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.486.500,09	4,35%	95	2,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.216.029,39	1,76%	33	1,11%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.386.478,91	2,68%	19	1,80%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	5.005.372,80	3,97%	169	1,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.271.667,92	1,80%	203	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.399.572,88	1,11%	151	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.381.251,37	1,09%	69	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.250.150,05	1,78%	77	1,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.092.535,47	6,41%	10.173	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.191.003,55	2,53%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.358.983,57	1,87%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	3.522.578,28	2,79%		2,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			124.516.632,94				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.636.654,16				Artigo 6º
Página 1 de 11			Total	126.153.287,10			

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

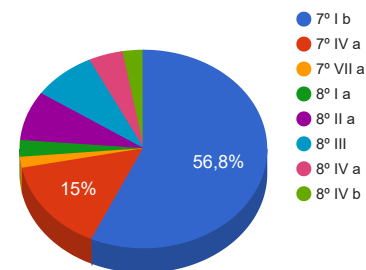
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70.729.993,46	56,80%	15,00%	25,00%	78,00%	26.392.980,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	74.709.979,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	18.711.015,29	15,03%	10,00%	30,00%	40,00%	31.095.637,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.216.029,39	1,78%	2,00%	5,00%	5,00%	4.009.802,26
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	3.386.478,91	2,72%	0,00%	0,00%	10,00%	9.065.184,38
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	10.057.864,97	8,08%	5,00%	10,00%	20,00%	14.845.461,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.342.685,52	8,31%	5,00%	10,00%	10,00%	2.108.977,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.549.987,12	4,46%	2,00%	5,00%	5,00%	675.844,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.522.578,28	2,83%	2,00%	5,00%	5,00%	2.703.253,37
Total Carteira		124.516.632,94					

RENDA FIXA	93.293.692,30	74,92%
RENDA VARIÁVEL	32.859.594,80	26,39%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	70.729.993,46	56,07%	15,00%	78,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	18.711.015,29	14,83%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.216.029,39	1,76%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	3.386.478,91	2,68%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	10.057.864,97	7,97%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	10.342.685,52	8,20%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.549.987,12	4,40%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.522.578,28	2,79%	2,00%	5,00%
Total	124.516.632,94	98,70%	41,00	263,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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	53.814.764,33	42,66%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.013.137,40	23,79%	0,00%
Bradesco Asset Management	15.496.183,12	12,28%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	7.736.650,14	6,13%	1,10%
ZION Invest	3.522.578,28	2,79%	0,72%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.191.003,55	2,53%	-
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	2.358.983,57	1,87%	1,18%
Aurora Capital	2.216.029,39	1,76%	1,08%
ITAÚ UNIBANCO	1.399.572,88	1,11%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	1.381.251,37	1,09%	0,19%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	0,70%	7,27%	2,05%	5,27%	10,58%	23,22%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-5,63%	-11,25%	-4,67%	-6,38%	-5,14%	-24,90%	1,65%	19,015%	13,14%
IRF-M 1	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,52%	4,50%	1,81%	3,45%	7,24%	14,42%	0,20%	0,181%	0,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,10%	0,181%	0,47%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	0,26%	4,29%	1,41%	3,03%	6,76%	14,66%	0,75%	0,322%	0,53%
IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,10%	8,82%	3,15%	6,29%	15,46%	-	0,40%	1,103%	3,32%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	12,00%	3,74%	8,33%	16,60%	23,55%	0,002	1,744%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,10%	7,06%	2,25%	5,13%	11,98%	20,25%	0,20%	0,743%	1,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	6,86%	2,15%	4,94%	11,84%	19,96%	0,20%	0,710%	1,89%
IMA-B 5	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	8,22%	2,70%	6,03%	14,23%	21,57%	0,20%	1,039%	2,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	8,23%	2,72%	6,06%	14,19%	21,56%	0,20%	1,022%	2,79%
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-

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

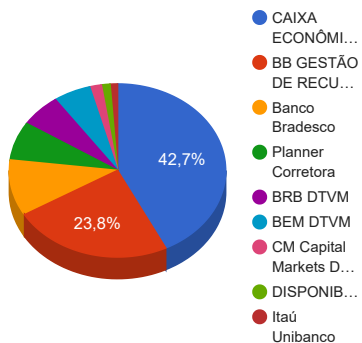
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,42%	16,06%	4,57%	10,60%	27,30%	32,79%	0,20%	2,483%	7,74%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

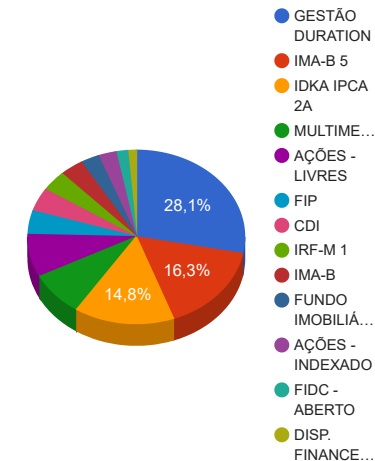
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	0,78%	7,93%	2,29%	5,76%	11,60%	25,51%	-	-	-
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,20%	-	-
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,61%	12,10%	4,31%	8,13%	18,20%	26,34%	0,50%	2,028%	3,71%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,23%	4,36%	1,45%	3,12%	6,54%	14,32%	1,00%	0,287%	0,50%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	2,76%	16,31%	8,38%	11,01%	37,16%	59,21%	1,50%	13,022%	11,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,58%	22,68%	11,81%	15,00%	47,57%	64,39%	2,50%	11,807%	15,46%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,37%	15,89%	4,32%	5,82%	32,26%	45,70%	2,00%	11,121%	15,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,90%	22,13%	3,09%	9,40%	52,10%	-	2,00%	11,657%	23,65%
IBX	-0,16%	16,75%	5,14%	7,34%	34,86%	44,77%	-	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC AÇÕES	0,37%	17,27%	6,43%	9,69%	36,64%	52,84%	0,90%	11,582%	12,14%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,89%	-9,30%	4,70%	-8,24%	-17,46%	-13,33%	1,60%	32,536%	28,97%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.814.764,33	42,66%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.013.137,40	23,79%
Banco Bradesco	13.224.515,20	10,48%
Planner Corretora	9.072.565,40	7,19%
BRB DTVM	7.736.650,14	6,13%
BEM DTVM	7.039.398,20	5,58%
CM Capital Markets DTVM	2.216.029,39	1,76%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.636.654,16	1,30%
Itaú Unibanco	1.399.572,88	1,11%

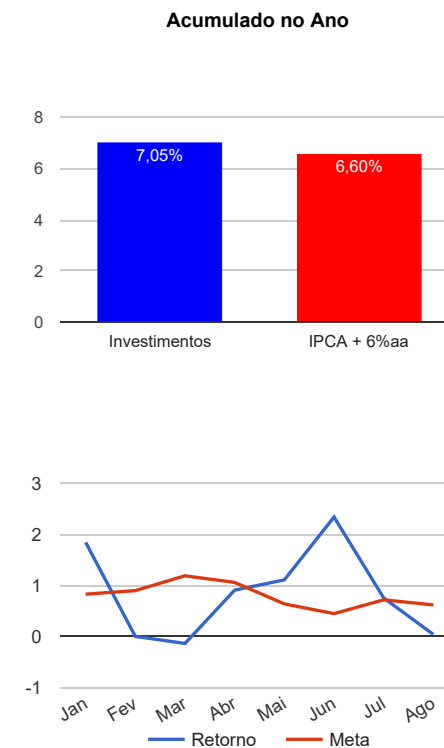


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	35.456.178,89	28,11%
IMA-B 5	20.617.044,22	16,34%
IDKA IPCA 2A	18.673.214,08	14,80%
MULTIMERCADO	10.342.685,52	8,20%
AÇÕES - LIVRES	10.057.864,97	7,97%
FIP	5.549.987,12	4,40%
CDI	5.486.500,09	4,35%
IRF-M 1	4.796.500,44	3,80%
IMA-B	4.411.571,03	3,50%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.522.578,28	2,79%
AÇÕES - INDEXADO	3.386.478,91	2,68%
FIDC - ABERTO	2.216.029,39	1,76%
DISP. FINANCEIRA	1.636.654,16	1,30%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	109.368.962,66	1.435.363,81	311.385,50	112.530.385,60	2.037.444,63	1,84%	0,83%	221,73%	2,06%
Fevereiro	112.530.385,60	19.740.469,76	18.599.442,39	113.676.488,33	5.075,36	0,00%	0,90%	0,50%	2,49%
Março	113.676.488,33	10.589.975,84	11.419.880,16	112.694.991,24	-151.592,77	-0,13%	1,19%	-11,17%	4,42%
Abril	112.694.991,24	3.272.310,64	175.000,00	116.845.004,68	1.052.702,80	0,91%	1,06%	85,81%	2,14%
Mai	116.845.004,68	2.170.099,04	1.005.059,39	119.320.187,54	1.310.143,21	1,11%	0,64%	173,29%	4,99%
Junho	119.320.187,54	310.468,10	1.537.267,77	120.885.298,87	2.791.911,00	2,34%	0,45%	519,57%	3,82%
Julho	120.885.298,87	31.845.367,30	27.765.923,04	125.909.125,34	944.382,21	0,76%	0,72%	104,35%	2,19%
Agosto	125.909.125,34	188.216,31	1.634.766,29	124.516.632,94	54.057,58	0,04%	0,62%	6,92%	3,65%
Acumulado no ano					8.044.124,02	7,05%	6,60%	106,92%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.893.563,05	0,00	0,00	2.908.520,87	14.957,82	0,52%	0,18%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.213.631,59	159.664,89	1.501.515,48	1.887.979,57	16.198,57	0,48%	0,18%	0,52%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	5.472.170,18	0,00	0,00	5.486.500,09	14.329,91	0,26%	0,32%	0,26%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	13.182.329,34	28.551,42	0,00	13.224.515,20	13.634,44	0,10%	1,10%	0,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.570.658,19	0,00	0,00	6.577.230,84	6.572,65	0,10%	0,74%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.089.662,00	0,00	0,00	12.095.983,24	6.321,24	0,05%	0,71%	0,05%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.348.174,72	0,00	133.250,81	2.216.029,39	1.105,48	0,05%	19,02%	-5,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.610.079,14	0,00	0,00	10.613.783,73	3.704,59	0,03%	1,04%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.999.845,68	0,00	0,00	10.003.260,49	3.414,81	0,03%	1,02%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	22.260.491,97	0,00	0,00	22.231.663,69	-28.828,28	-0,13%	1,74%	-0,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.430.311,44	0,00	0,00	4.411.571,03	-18.740,41	-0,42%	2,48%	-0,42%
Total Renda Fixa					32.670,82	0,04%	1,57%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.210.668,18	0,00	0,00	2.271.667,92	60.999,74	2,76%	13,02%	2,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.377.832,84	0,00	0,00	1.399.572,88	21.740,04	1,58%	11,81%	1,58%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.043.810,53	0,00	0,00	8.092.535,47	48.724,94	0,61%	2,03%	0,61%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC AÇÕES	3.374.128,78	0,00	0,00	3.386.478,91	12.350,13	0,37%	11,58%	0,37%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.245.047,93	0,00	0,00	2.250.150,05	5.102,12	0,23%	0,29%	0,23%
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	2.362.663,98	0,00	0,00	2.358.983,57	-3.680,41	-0,16%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.196.525,38	0,00	0,00	3.191.003,55	-5.521,83	-0,17%	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.386.383,59	0,00	0,00	1.381.251,37	-5.132,22	-0,37%	11,12%	-0,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	5.050.826,66	0,00	0,00	5.005.372,80	-45.453,86	-0,90%	11,66%	-0,90%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	3.590.320,17	0,00	0,00	3.522.578,28	-67.741,89	-1,89%	32,54%	-1,89%
Total Renda Variável					21.386,76	0,07%	10,64%	