

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)

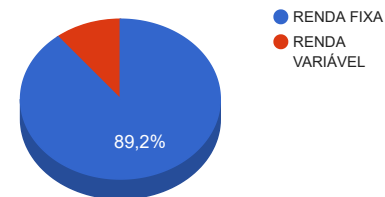
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			5.632.869,38	12,01%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.188.603,79	11,07%	940	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.728.051,25	12,22%	915	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.293.048,85	7,02%	542	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	935.919,13	2,00%	24	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.692.594,41	5,74%	875	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.911.304,18	8,34%	1.390	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.424.633,78	15,83%	630	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	455.827,27	0,97%	270	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	260.213,80	0,55%	333	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	3.236.855,99	6,90%	480	1,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.080.697,24	6,57%	107	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	963.068,27	2,05%	1.495	1,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	4.086.479,52	8,72%	219	0,74%	Artigo 8º, Inciso III
		Total	46.890.166,86				

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

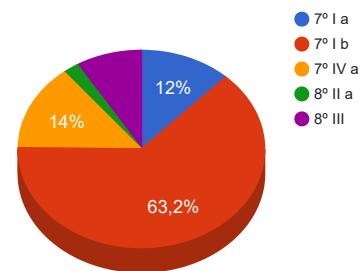
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	5.632.869,38	12,01%	0,00%	13,00%	20,00%	3.745.163,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	29.629.982,66	63,19%	15,00%	35,00%	70,00%	3.193.134,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	55,00%	25.789.591,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.577.767,03	14,03%	10,00%	25,00%	40,00%	12.178.299,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.344.508,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.344.508,34
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	963.068,27	2,05%	0,00%	5,00%	20,00%	8.414.965,10
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.086.479,52	8,72%	7,00%	10,00%	10,00%	602.537,17
Total Carteira		46.890.166,86					

RENDA FIXA	41.840.619,07	89,23%
RENDA VARIÁVEL	5.049.547,79	10,77%

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 " a "	5.632.869,38	12,01%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	29.629.982,66	63,19%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	55,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.577.767,03	14,03%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
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 "	963.068,27	2,05%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.086.479,52	8,72%	7,00%	10,00%
Total	46.890.166,86	100,00%	32,00	235,00

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	25.749.662,79	54,91%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.072.122,78	21,48%	0,00%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	5.632.869,38	12,01%	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.536.524,51	7,54%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	1.898.987,40	4,05%	0,00%

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 + 6,00% ao ano	0,62%	6,60%	1,81%	4,78%	9,56%	20,95%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,03%	7,23%	2,56%	5,74%	10,48%	18,23%	0,30%	1,036%	1,50%
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%
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,52%	4,45%	1,79%	3,41%	7,17%	14,26%	0,20%	0,182%	0,44%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,50%	4,31%	1,74%	3,31%	7,04%	13,90%	0,40%	0,180%	0,45%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	3,60%	1,33%	2,68%	5,40%	11,68%	0,80%	0,003%	0,10%
IMA Geral ex-C	0,17%	8,94%	3,09%	6,43%	15,60%	22,43%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	9,42%	3,30%	6,85%	16,13%	22,79%	0,30%	1,176%	3,39%
IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
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%

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

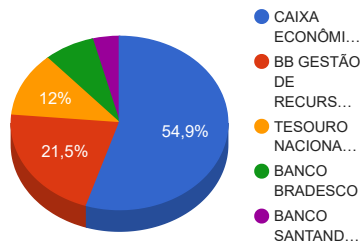
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,44%	16,08%	4,53%	10,54%	27,74%	32,89%	0,20%	2,521%	7,99%

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

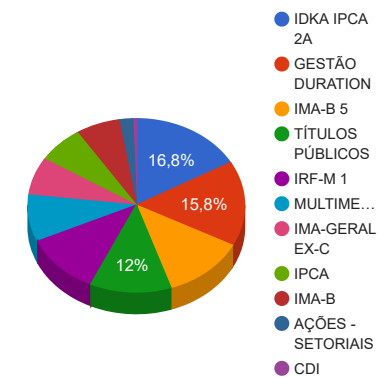
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,14%	1,63%	3,68%	8,27%	15,85%	0,60%	1,866%	0,74%
PETROBRAS ON - PETR3	-1,10%	12,49%	0,87%	-4,31%	30,15%	106,53%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	-1,38%	10,12%	0,01%	-5,82%	26,18%	94,26%	3,00%	18,250%	35,62%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.749.662,79	54,91%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.072.122,78	21,48%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	5.632.869,38	12,01%
BANCO BRADESCO	3.536.524,51	7,54%
BANCO SANTANDER	1.898.987,40	4,05%



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	7.881.198,20	16,81%
GESTÃO DURATION	7.424.633,78	15,83%
IMA-B 5	5.728.051,25	12,22%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.632.869,38	12,01%
IRF-M 1	5.303.050,58	11,31%
MULTIMERCADO	4.086.479,52	8,72%
IMA-GERAL EX-C	3.293.048,85	7,02%
IPCA	3.236.855,99	6,90%
IMA-B	3.080.697,24	6,57%
AÇÕES - SETORIAIS	963.068,27	2,05%
CDI	260.213,80	0,55%



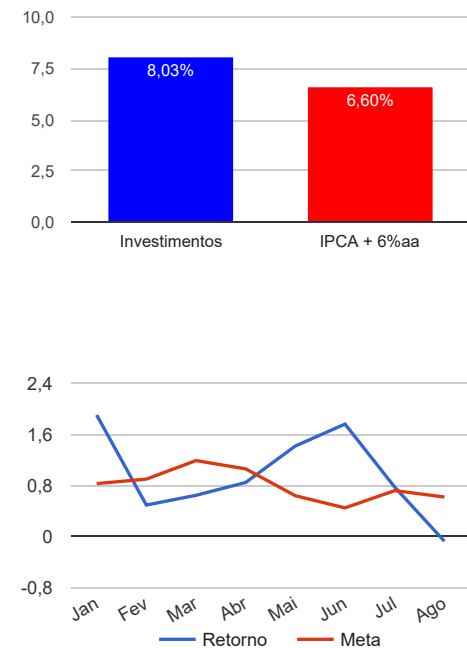
Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	3.682,205365	743.672,41	1.841.102,68
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.682,205365	403.538,02	994.195,45
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	4.440,589288	695.984,05	2.797.571,25

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	39.753.444,62	1.968.013,87	338.080,69	42.170.818,62	787.440,82	1,90%	0,83%	228,80%	0,81%
Fevereiro	42.170.818,62	3.793.921,55	4.078.754,57	42.094.410,87	208.425,27	0,49%	0,90%	55,19%	0,96%
Março	42.094.410,87	3.710.901,95	4.111.571,20	41.965.831,55	272.089,93	0,65%	1,19%	54,15%	1,71%
Abril	41.965.831,55	7.488.071,40	7.315.780,34	42.495.255,99	357.133,38	0,85%	1,06%	79,99%	1,07%
Mai	42.495.255,99	4.413.362,77	4.193.309,03	43.321.011,13	605.701,40	1,42%	0,64%	221,34%	0,95%
Junho	43.321.011,13	8.416.007,56	6.129.636,18	46.410.465,41	803.082,90	1,76%	0,45%	391,01%	1,19%
Julho	46.410.465,41	2.381.072,12	1.607.452,22	47.549.888,82	365.803,51	0,78%	0,72%	107,04%	0,75%
Agosto	47.549.888,82	5.239.154,61	5.864.851,74	46.890.166,86	-34.024,83	-0,07%	0,62%	-11,53%	1,60%
Acumulado no ano					3.365.652,38	8,03%	6,60%	121,67%	

Acumulado no Ano



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(%)
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	453.447,51	0,00	0,00	455.827,27	2.379,76	0,52%	0,18%	0,52%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	931.234,83	0,00	0,00	935.919,13	4.684,30	0,50%	0,18%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.064.023,32	829.825,19	0,00	3.911.304,18	17.455,67	0,45%	0,18%	0,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	526.190,69	0,00	527.117,18	0,00	926,49	0,18%	0,01%	0,49%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.119.807,62	0,00	3.124.073,78	0,00	4.266,16	0,14%	0,00%	0,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.183.418,82	0,00	0,00	5.188.603,79	5.184,97	0,10%	0,74%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.290.260,75	0,00	0,00	3.293.048,85	2.788,10	0,08%	1,18%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.640.392,57	758.138,46	2.140.008,34	260.213,80	1.691,11	0,07%	0,00%	0,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.691.187,29	0,00	0,00	2.692.594,41	1.407,12	0,05%	0,71%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.726.051,95	0,00	0,00	5.728.051,25	1.999,30	0,03%	1,04%	0,03%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	3.235.768,53	0,00	0,00	3.236.855,99	1.087,46	0,03%	1,04%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.909.732,18	527.117,18	0,00	7.424.633,78	-12.215,58	-0,16%	1,74%	-0,13%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.736.719,43	0,00	73.652,44	5.632.869,38	-30.197,61	-0,53%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	3.124.073,78	0,00	3.080.697,24	-43.376,54	-1,39%	2,52%	-0,44%
Total Renda Fixa					-41.919,29	-0,10%	1,12%	

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(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.065.067,50	0,00	0,00	4.086.479,52	21.412,02	0,53%	1,87%	0,53%
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	976.585,83	0,00	0,00	963.068,27	-13.517,56	-1,38%	18,25%	-1,38%
Total Renda Variável					7.894,46	0,16%	4,99%	

