

# 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)

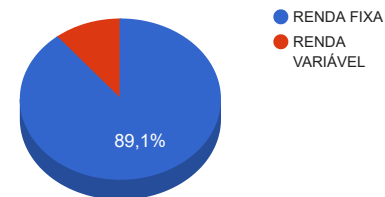
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			5.806.345,90	12,27%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	941.553,11	1,99%	24	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.730.622,03	5,77%	876	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.707.886,11	7,84%	1.389	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	458.658,78	0,97%	267	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.262.512,29	11,12%	937	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.581.911,31	16,02%	643	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.826.580,79	12,31%	913	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.342.409,21	7,06%	552	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.169.993,44	6,70%	110	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.254,11	0,07%	333	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	3.292.157,99	6,96%	500	1,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.023.952,60	2,16%	1.477	1,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	4.139.580,27	8,75%	214	0,79%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>Total</b>	<b>47.316.417,94</b>				

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

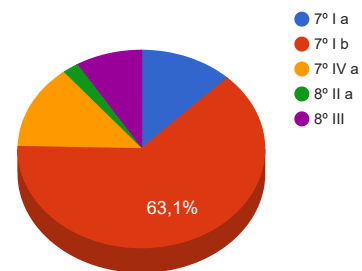
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	5.806.345,90	12,27%	0,00%	13,00%	20,00%	3.656.937,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	29.852.133,63	63,09%	15,00%	35,00%	70,00%	3.269.358,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	55,00%	26.024.029,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.494.405,54	13,73%	10,00%	25,00%	40,00%	12.432.161,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.365.820,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.365.820,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.023.952,60	2,16%	0,00%	5,00%	20,00%	8.439.330,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.139.580,27	8,75%	7,00%	10,00%	10,00%	592.061,52
<b>Total Carteira</b>		<b>47.316.417,94</b>					

RENDA FIXA	42.152.885,07	89,09%
RENDA VARIÁVEL	5.163.532,87	10,91%

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 " a "	5.806.345,90	12,27%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	29.852.133,63	63,09%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	55,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.494.405,54	13,73%	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 "	1.023.952,60	2,16%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.139.580,27	8,75%	7,00%	10,00%
<b>Total</b>	<b>47.316.417,94</b>	<b>100,00%</b>	<b>32,00</b>	<b>235,00</b>

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	25.703.302,60	54,32%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.212.611,51	21,58%	0,00%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	5.806.345,90	12,27%	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.628.652,22	7,67%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	1.965.505,71	4,15%	0,00%

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%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,90%	19,45%	3,70%	13,17%	31,74%	34,29%	0,20%	2,006%	7,61%
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	8,36%	2,46%	5,73%	12,10%	20,62%	0,20%	0,887%	1,93%
IMA Geral ex-C	1,46%	10,53%	2,59%	7,40%	16,57%	22,60%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	11,06%	2,62%	7,89%	17,17%	23,01%	0,30%	0,853%	3,32%
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%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	5,10%	1,85%	3,58%	7,18%	14,15%	0,20%	0,115%	0,44%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,60%	4,94%	1,79%	3,49%	7,07%	13,80%	0,40%	0,115%	0,45%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,39%	4,01%	1,32%	2,67%	5,39%	11,49%	0,80%	0,007%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	7,07%	1,80%	4,01%	9,04%	20,73%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,71%	9,06%	2,67%	6,81%	11,49%	19,30%	0,30%	1,010%	1,73%

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
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,12%	14,38%	3,11%	10,02%	18,30%	25,15%	0,002	1,371%	3,53%

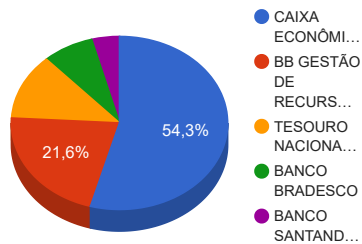
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS ON - PETR3	6,65%	19,98%	1,16%	-2,17%	26,49%	94,63%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	6,32%	17,08%	0,25%	-3,79%	22,47%	82,96%	3,00%	11,287%	35,06%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,30%	6,51%	2,25%	4,57%	8,42%	16,47%	0,60%	0,833%	0,84%

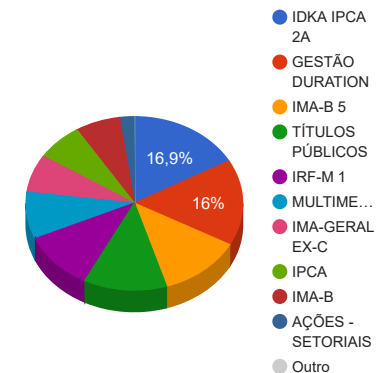


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (setembro / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.703.302,60	54,32%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.212.611,51	21,58%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	5.806.345,90	12,27%
BANCO BRADESCO	3.628.652,22	7,67%
BANCO SANTANDER	1.965.505,71	4,15%



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	7.993.134,32	16,89%
GESTÃO DURATION	7.581.911,31	16,02%
IMA-B 5	5.826.580,79	12,31%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.806.345,90	12,27%
IRF-M 1	5.108.098,00	10,80%
MULTIMERCADO	4.139.580,27	8,75%
IMA-GERAL EX-C	3.342.409,21	7,06%
IPCA	3.292.157,99	6,96%
IMA-B	3.169.993,44	6,70%
AÇÕES - SETORIAIS	1.023.952,60	2,16%
CDI	32.254,11	0,07%



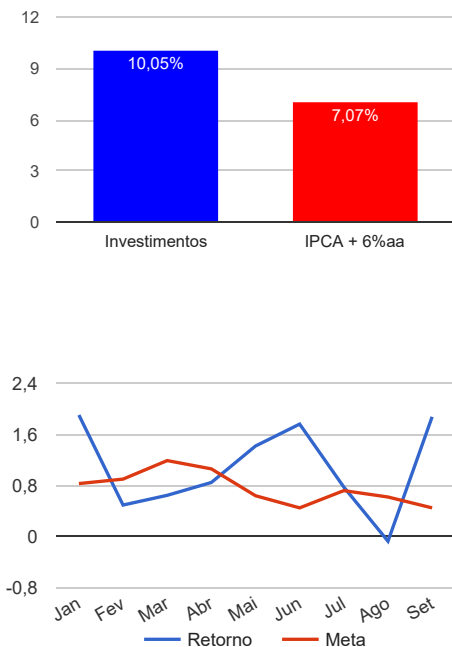
Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 2019)

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	1.487,344824	743.672,41	743.672,41
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	1.494,58526	403.538,02	403.538,02
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	1.104,73659	695.984,05	695.984,05

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%
Setembro	46.890.166,86	3.214.514,76	3.667.288,11	47.316.417,94	879.024,43	1,87%	0,45%	419,80%	1,23%
Acumulado no ano					4.244.676,81	10,05%	7,07%	142,11%	

Acumulado no Ano



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(%)
TÍTULOS PÚBLICOS	5.632.869,38	0,00	0,00	5.806.345,90	173.476,52	3,08%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.080.697,24	0,00	0,00	3.169.993,44	89.296,20	2,90%	2,01%	2,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.424.633,78	0,00	0,00	7.581.911,31	157.277,53	2,12%	1,37%	2,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.728.051,25	0,00	0,00	5.826.580,79	98.529,54	1,72%	1,01%	1,72%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	3.236.855,99	0,00	0,00	3.292.157,99	55.302,00	1,71%	1,01%	1,71%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.293.048,85	0,00	0,00	3.342.409,21	49.360,36	1,50%	0,85%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.188.603,79	0,00	0,00	5.262.512,29	73.908,50	1,42%	0,82%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.692.594,41	0,00	0,00	2.730.622,03	38.027,62	1,41%	0,89%	1,41%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	455.827,27	0,00	0,00	458.658,78	2.831,51	0,62%	0,12%	0,62%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	935.919,13	0,00	0,00	941.553,11	5.633,98	0,60%	0,11%	0,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.911.304,18	1.036.464,07	1.260.000,00	3.707.886,11	20.117,86	0,41%	0,12%	0,63%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	260.213,80	2.178.050,69	2.407.288,11	32.254,11	1.277,73	0,05%	0,01%	0,39%
Total Renda Fixa					765.039,35	1,83%	0,99%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	963.068,27	0,00	0,00	1.023.952,60	60.884,33	6,32%	11,29%	6,32%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.086.479,52	0,00	0,00	4.139.580,27	53.100,75	1,30%	0,83%	1,30%
Total Renda Variável					113.985,08	2,26%	2,91%	

## 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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	5.655.677,08	0,00	73.652,44	5.806.345,90	224.321,26	4,01%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.834.097,79	527.117,18	0,00	7.581.911,31	220.696,34	3,08%	3,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.672.324,14	0,00	0,00	5.826.580,79	154.256,65	2,72%	2,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.136.297,38	0,00	0,00	5.262.512,29	126.214,91	2,46%	2,46%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	3.206.688,83	0,00	0,00	3.292.157,99	85.469,16	2,67%	2,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.509.128,18	752.953,67	0,00	3.342.409,21	80.327,36	2,46%	2,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.665.012,07	0,00	0,00	2.730.622,03	65.609,96	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.142.348,19	1.866.289,26	2.360.000,00	3.707.886,11	59.248,66	1,38%	1,86%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	3.124.073,78	0,00	3.169.993,44	45.919,66	1,47%	3,70%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.102.399,83	0,00	3.124.073,78	0,00	21.673,95	0,70%	1,52%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	924.964,38	0,00	0,00	941.553,11	16.588,73	1,79%	1,79%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	450.331,64	0,00	0,00	458.658,78	8.327,14	1,85%	1,85%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	518.060,59	4.564.307,60	5.054.748,67	32.254,11	4.634,59	0,20%	1,32%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	523.310,46	0,00	527.117,18	0,00	3.806,72	0,73%	1,49%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.117.095,09</b>	<b>2,68%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.048.418,12	0,00	0,00	4.139.580,27	91.162,15	2,25%	2,25%
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	1.021.406,73	0,00	0,00	1.023.952,60	2.545,87	0,25%	0,25%
Total Renda Variável					93.708,02	1,85%	

