

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2019)

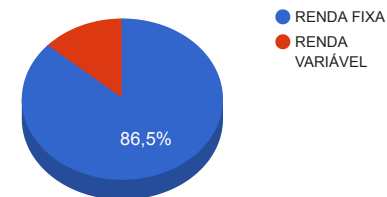
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	5.335.865,14	11,35%	600	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.968.946,45	6,31%	1.391	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.227.294,06	2,61%	408	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.616.615,50	9,82%	902	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.952.383,38	10,53%	937	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.558.447,00	7,57%	517	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.846.958,15	3,93%	597	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.582.683,96	7,62%	877	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.600.262,70	3,40%	696	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	403.633,60	0,86%	1.230	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.384.309,72	2,94%	724	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	66.374,17	0,14%	403	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.120.529,26	6,64%	258	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	680.611,68	1,45%	56	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.436.470,15	3,05%	784	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.922.301,35	8,34%	126	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.255.771,00	4,80%	200	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.588.956,77	3,38%	150	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	945.614,80	2,01%	729	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.213.808,49	2,58%	227	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	322.410,32	0,69%	8.060	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
Total			47.030.247,65				

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

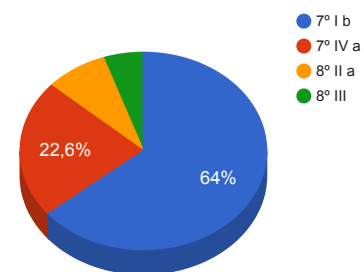
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	80,00%	37.624.198,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	30.093.089,94	63,99%	30,00%	50,00%	70,00%	2.828.083,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	10.610.596,33	22,56%	10,00%	20,00%	40,00%	8.201.502,73
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.703.024,77
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	3.844.727,77	8,18%	0,00%	5,00%	10,00%	858.297,00
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.481.833,61	5,28%	0,00%	10,00%	10,00%	2.221.191,16
Total Carteira		47.030.247,65					

RENDA FIXA	40.703.686,27	86,55%
RENDA VARIÁVEL	6.326.561,38	13,45%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	30.093.089,94	63,99%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	10.610.596,33	22,56%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	3.844.727,77	8,18%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.481.833,61	5,28%	0,00%	10,00%
Total Renda Fixa	47.030.247,65	100,00%	40,00	256,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	22.552.585,65	47,95%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.590.103,62	28,90%	0,00%
Bradesco Asset Management	6.178.072,35	13,14%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	4.709.486,03	10,01%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,09%	8,14%	5,09%	6,66%	15,28%	24,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	7,94%	5,04%	6,50%	14,99%	24,00%	0,20%	0,638%	4,08%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	8,01%	5,04%	6,55%	15,04%	24,05%	0,20%	0,631%	3,81%
IDKA IPCA 2 Anos	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,80%	3,06%	5,52%	11,69%	21,08%	0,20%	0,584%	1,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	6,95%	3,23%	5,61%	11,87%	21,28%	0,20%	0,578%	1,92%
IMA-B 5	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	8,20%	4,09%	6,58%	13,86%	23,03%	0,20%	0,759%	2,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,18%	4,07%	6,55%	13,88%	23,03%	0,20%	0,752%	2,96%
IMA Geral ex-C	0,95%	8,76%	4,79%	6,72%	15,13%	23,52%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	9,33%	5,29%	7,17%	15,58%	24,01%	0,30%	0,697%	3,60%
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	3,95%	1,94%	3,37%	7,11%	14,84%	0,20%	0,124%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,56%	3,66%	1,59%	3,10%	6,29%	13,68%	0,20%	0,009%	0,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	3,64%	1,62%	3,09%	6,23%	13,60%	0,20%	0,014%	0,13%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	3,58%	1,55%	3,03%	6,19%	13,55%	0,20%	0,004%	0,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	3,57%	1,54%	3,03%	6,22%	13,77%	0,20%	0,003%	0,12%
IPCA	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	12,15%	6,69%	9,01%	16,92%	25,04%	0,002	1,027%	3,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	9,39%	5,38%	6,85%	13,32%	22,76%	0,40%	0,570%	2,79%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,93%	8,71%	4,86%	6,62%	14,93%	-	0,40%	0,649%	3,51%

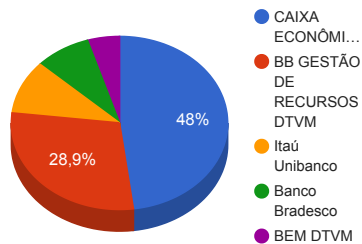
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,95%	20,77%	12,77%	11,53%	39,89%	74,37%	2,50%	6,181%	16,97%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1,72%	13,18%	6,55%	6,88%	30,34%	68,37%	1,50%	6,673%	12,86%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,53%	3,15%	1,55%	2,58%	7,07%	-	1,60%	0,099%	1,79%

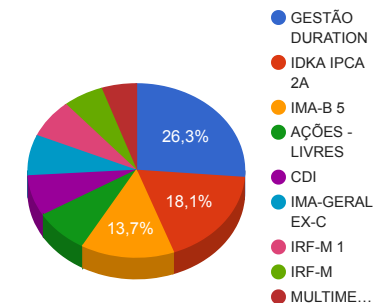
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,32%	11,43%	5,71%	7,47%	17,52%	27,80%	0,50%	1,150%	3,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,41%	4,59%	1,88%	3,75%	7,15%	16,20%	0,60%	0,261%	1,39%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.552.585,65	47,95%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.590.103,62	28,90%
Itaú Unibanco	4.709.486,03	10,01%
Banco Bradesco	3.922.301,35	8,34%
BEM DTVM	2.255.771,00	4,80%



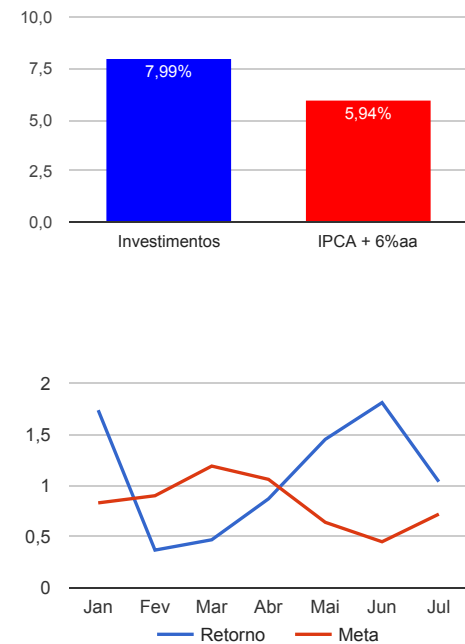
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	12.378.695,75	26,32%
IDKA IPCA 2A	8.535.067,34	18,15%
IMA-B 5	6.463.573,65	13,74%
AÇÕES - LIVRES	3.844.727,77	8,18%
CDI	3.567.765,72	7,59%
IMA-GERAL EX-C	3.558.447,00	7,57%
IRF-M 1	3.372.580,05	7,17%
IRF-M	2.827.556,76	6,01%
MULTIMERCADO	2.481.833,61	5,28%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	33.088.919,14	14.623.050,62	12.416.735,37	35.908.187,14	612.952,75	1,74%	0,83%	208,83%	1,10%
Fevereiro	35.908.187,14	772.570,26	48.388,14	36.767.288,05	134.918,79	0,37%	0,90%	41,13%	1,55%
Março	36.767.288,05	2.486.654,17	68.055,54	39.369.793,80	183.907,12	0,47%	1,19%	39,32%	2,28%
Abril	39.369.793,80	1.566.892,62	71.418,22	41.220.756,52	355.488,32	0,87%	1,06%	82,10%	1,14%
Mai	41.220.756,52	3.898.362,58	3.100.354,02	42.628.620,14	609.855,06	1,45%	0,64%	226,55%	1,37%
Junho	42.628.620,14	1.350.973,30	134.469,58	44.638.974,02	793.850,16	1,81%	0,45%	402,05%	1,48%
Julho	44.638.974,02	2.007.632,04	99.342,08	47.030.247,65	482.983,67	1,04%	0,72%	143,27%	1,06%
Acumulado no ano					3.173.955,87	7,99%	5,94%	134,61%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.277.458,42	0,00	0,00	5.335.865,14	58.406,72	1,11%	1,03%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.214.085,36	0,00	0,00	1.227.294,06	13.208,70	1,09%	0,64%	1,09%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.583.273,36	0,00	0,00	1.600.262,70	16.989,34	1,07%	0,63%	1,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.091.245,06	0,00	0,00	3.120.529,26	29.284,20	0,95%	0,57%	0,95%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.791.995,27	37.655,58	0,00	1.846.958,15	17.307,30	0,95%	0,76%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.566.004,86	7.361,80	0,00	4.616.615,50	43.248,84	0,95%	0,75%	0,95%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.886.323,51	0,00	0,00	3.922.301,35	35.977,84	0,93%	0,65%	0,93%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.907.362,24	0,00	0,00	4.952.383,38	45.021,14	0,92%	0,58%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.875.437,47	653.572,30	0,00	3.558.447,00	29.437,23	0,83%	0,70%	1,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.940.409,13	613.968,47	0,00	3.582.683,96	28.306,36	0,80%	0,58%	0,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.948.312,04	0,00	0,00	2.968.946,45	20.634,41	0,70%	0,12%	0,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	400.831,01	0,00	0,00	403.633,60	2.802,59	0,70%	0,12%	0,70%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	676.831,85	0,00	0,00	680.611,68	3.779,83	0,56%	0,01%	0,56%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	66.006,13	0,00	0,00	66.374,17	368,04	0,56%	0,01%	0,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.422.117,92	3.864,18	49.303,09	1.384.309,72	7.630,71	0,54%	0,00%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.336.796,30	141.857,65	50.038,99	1.436.470,15	7.855,19	0,53%	0,00%	0,55%
Total Renda Fixa					360.258,44	0,89%	0,60%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.514.064,45	0,00	0,00	1.588.956,77	74.892,32	4,95%	6,18%	4,95%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.990.941,12	230.079,33	0,00	2.255.771,00	34.750,55	1,56%	6,67%	1,72%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	319.272,73	0,00	322.410,32	3.137,59	0,98%	1,15%	1,32%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	940.641,45	0,00	0,00	945.614,80	4.973,35	0,53%	0,10%	0,53%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.208.837,07	0,00	0,00	1.213.808,49	4.971,42	0,41%	0,26%	0,41%
Total Renda Variável					122.725,23	1,98%	4,06%	