

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)

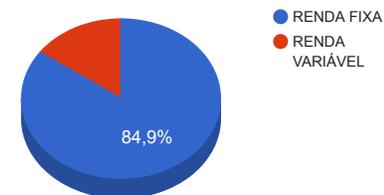
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.847.588,86	3,88%	605	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.622.518,23	7,60%	875	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	405.720,12	0,85%	1.214	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.604.069,72	3,37%	700	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.984.532,38	6,26%	1.390	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.003.927,61	14,69%	630	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.229.708,22	2,58%	417	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.561.462,36	7,47%	542	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.622.230,30	9,70%	915	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.957.337,22	10,40%	940	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	194.416,21	0,41%	770	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.926.384,48	8,24%	136	0,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.355.887,26	2,84%	701	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.130.417,12	6,57%	271	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	370.111,49	0,78%	169	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.318.015,27	4,86%	203	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.614.028,01	3,39%	151	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15 du	Não há	354.932,86	0,74%	27	0,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	391.210,21	0,82%	10.173	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.220.202,01	2,56%	219	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	949.380,30	1,99%	729	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
Total			47.664.080,24				

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

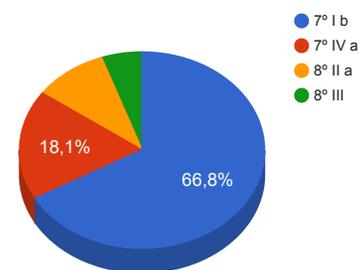
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	80,00%	38.131.264,19
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	31.839.095,02	66,80%	30,00%	50,00%	70,00%	1.525.761,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.607.105,07	18,06%	10,00%	20,00%	40,00%	10.458.527,03
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.766.408,02
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.657.087,63	9,77%	0,00%	5,00%	10,00%	109.320,39
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.560.792,52	5,37%	0,00%	10,00%	10,00%	2.205.615,50
Total Carteira		47.664.080,24					

RENDA FIXA	40.446.200,09	84,86%
RENDA VARIÁVEL	7.217.880,15	15,14%

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 "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	31.839.095,02	66,80%	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 "	8.607.105,07	18,06%	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 "	4.657.087,63	9,77%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.560.792,52	5,37%	0,00%	10,00%
Total	47.664.080,24	100,00%	40,00	256,00

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	22.687.675,31	47,60%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.987.560,05	29,35%	0,00%
Bradesco Asset Management	6.244.399,75	13,10%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	4.744.445,13	9,95%	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
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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,08%	1,51%	3,03%	6,16%	13,44%	0,20%	0,008%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,49%	4,09%	1,50%	3,04%	6,12%	13,21%	0,20%	0,005%	0,12%

IRF-M	0,26%	8,42%	3,54%	6,63%	16,67%	23,59%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	8,26%	3,48%	6,51%	16,43%	23,07%	0,20%	1,047%	3,22%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	8,15%	3,46%	6,42%	16,48%	23,01%	0,20%	1,066%	3,46%

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%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	9,73%	3,85%	6,83%	13,26%	21,71%	0,40%	0,534%	2,80%
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%

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
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%

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

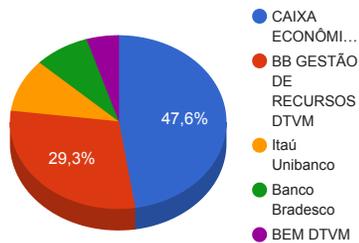
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,61%	12,10%	4,31%	8,13%	18,20%	26,34%	0,50%	2,028%	3,71%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,14%	1,63%	3,68%	8,27%	15,85%	0,60%	1,866%	0,74%

Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
BRADESCO 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%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,40%	3,56%	1,42%	2,70%	7,96%	-	1,60%	0,106%	1,45%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,90%	22,13%	3,09%	9,40%	52,10%	-	2,00%	11,657%	23,65%

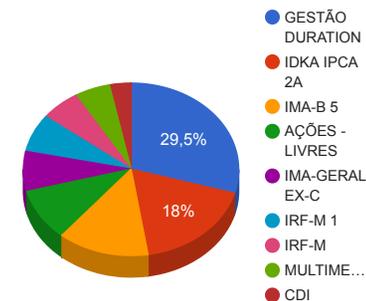
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-0,66%	-	-	-	-	-	2,00%	11,815%	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.687.675,31	47,60%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.987.560,05	29,35%
Itaú Unibanco	4.744.445,13	9,95%
Banco Bradesco	3.926.384,48	8,24%
BEM DTVM	2.318.015,27	4,86%



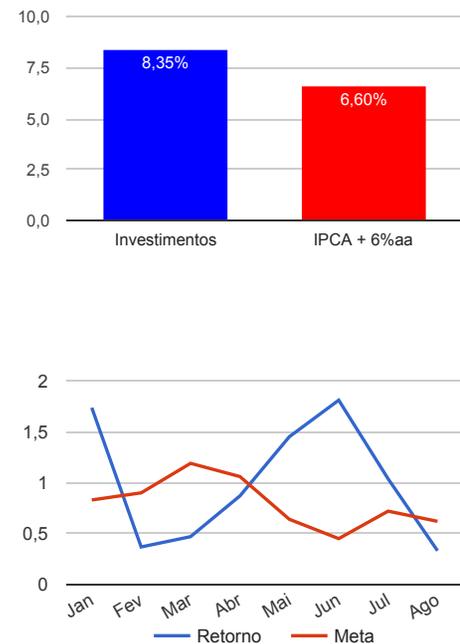
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	14.060.729,21	29,50%
IDKA IPCA 2A	8.579.855,45	18,00%
IMA-B 5	6.469.819,16	13,57%
AÇÕES - LIVRES	4.657.087,63	9,77%
IMA-GERAL EX-C	3.561.462,36	7,47%
IRF-M 1	3.390.252,50	7,11%
IRF-M	2.833.777,94	5,95%
MULTIMERCADO	2.560.792,52	5,37%
CDI	1.550.303,47	3,25%



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%
Agosto	47.030.247,65	2.655.909,44	2.179.499,63	47.664.080,24	157.422,78	0,33%	0,62%	53,40%	2,10%
Acumulado no ano					3.331.378,65	8,35%	6,60%	126,62%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.968.946,45	0,00	0,00	2.984.532,38	15.585,93	0,52%	0,18%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	403.633,60	0,00	0,00	405.720,12	2.086,52	0,52%	0,18%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.384.309,72	4.514,13	39.675,15	1.355.887,26	6.738,56	0,49%	0,01%	0,49%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.436.470,15	142.112,97	1.390.093,15	194.416,21	5.926,24	0,38%	0,01%	0,49%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	680.611,68	0,00	683.119,12	0,00	2.507,44	0,37%	0,02%	0,50%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	66.374,17	0,00	66.612,21	0,00	238,04	0,36%	0,02%	0,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.120.529,26	0,00	0,00	3.130.417,12	9.887,86	0,32%	0,53%	0,32%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.600.262,70	0,00	0,00	1.604.069,72	3.807,02	0,24%	1,05%	0,24%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.227.294,06	0,00	0,00	1.229.708,22	2.414,16	0,20%	1,07%	0,20%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.922.301,35	0,00	0,00	3.926.384,48	4.083,13	0,10%	1,10%	0,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.952.383,38	0,00	0,00	4.957.337,22	4.953,84	0,10%	0,74%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.558.447,00	0,00	0,00	3.561.462,36	3.015,36	0,08%	1,18%	0,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.582.683,96	37.961,01	0,00	3.622.518,23	1.873,26	0,05%	0,71%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.616.615,50	4.002,88	0,00	4.622.230,30	1.611,92	0,03%	1,04%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.846.958,15	0,00	0,00	1.847.588,86	630,71	0,03%	1,02%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.335.865,14	1.686.565,50	0,00	7.003.927,61	-18.503,03	-0,26%	1,74%	-0,13%
Total Renda Fixa					46.856,96	0,12%	0,96%	

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(%)
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	338.960,29	0,00	354.932,86	15.972,57	4,71%	11,81%	-0,66%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.255.771,00	0,00	0,00	2.318.015,27	62.244,27	2,76%	13,02%	2,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.588.956,77	0,00	0,00	1.614.028,01	25.071,24	1,58%	11,81%	1,58%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	322.410,32	66.598,36	0,00	391.210,21	2.201,53	0,57%	2,03%	0,61%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.213.808,49	0,00	0,00	1.220.202,01	6.393,52	0,53%	1,87%	0,53%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	945.614,80	0,00	0,00	949.380,30	3.765,50	0,40%	0,11%	0,40%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	375.194,30	0,00	370.111,49	-5.082,81	-1,35%	11,66%	-0,90%
Total Renda Variável					110.565,82	1,56%	8,44%	