

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 2019)

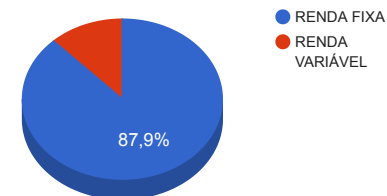
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			36.951,24	0,09%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.847.441,04	11,36%	897	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.239.622,01	5,25%	866	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.529.797,48	5,93%	488	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.550.100,50	3,63%	690	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	398.549,24	0,93%	1.253	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.744.292,07	4,09%	546	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.931.501,08	6,87%	1.439	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.188.571,15	2,79%	385	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.485.817,07	10,51%	864	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.413.647,82	3,31%	830	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	5.136.972,44	12,04%	513	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	673.708,85	1,58%	60	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.462.612,82	3,43%	762	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.787.464,87	8,88%	105	0,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.014.452,05	7,07%	238	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	65.688,87	0,15%	413	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.578.119,06	3,70%	194	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.443.553,78	3,38%	150	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.200.601,24	2,81%	230	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	936.106,70	2,19%	729	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
TOTAL -			42.665.571,38				

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

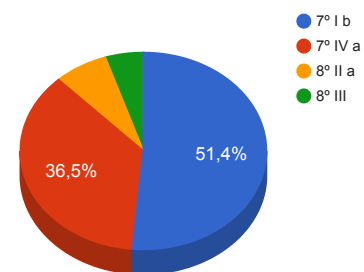
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	80,00%	34.132.457,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	21.915.691,64	51,37%	30,00%	50,00%	70,00%	7.950.208,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	15.554.547,72	36,46%	10,00%	20,00%	40,00%	1.511.680,83
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.266.557,14
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	3.021.672,84	7,08%	0,00%	5,00%	10,00%	1.244.884,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.136.707,94	5,01%	0,00%	10,00%	10,00%	2.129.849,20
Total Carteira		42.628.620,14					

RENDA FIXA	37.507.190,60	87,99%
RENDA VARIÁVEL	5.158.380,78	12,10%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 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 "	21.915.691,64	51,37%	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 "	15.554.547,72	36,46%	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 "	3.021.672,84	7,08%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.136.707,94	5,01%	0,00%	10,00%
Total Renda Fixa	42.628.620,14	99,91%	40,00	256,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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	21.679.455,02	50,81%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.125.575,36	26,08%	0,00%
Bradesco Asset Management	5.365.583,93	12,58%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	4.458.005,83	10,45%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral ex-C	1,83%	5,68%	3,24%	6,93%	13,55%	23,86%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	5,93%	3,44%	7,17%	13,73%	24,05%	0,30%	1,099%	2,94%
IRF-M	1,77%	4,72%	2,99%	6,33%	13,33%	25,08%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,75%	4,62%	2,93%	6,20%	13,10%	24,56%	0,20%	1,009%	3,36%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,73%	4,54%	2,86%	6,08%	13,17%	24,52%	0,20%	1,018%	3,47%
IMA-B 5	1,39%	5,47%	3,31%	6,91%	13,22%	24,34%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,37%	5,37%	3,25%	6,79%	12,98%	23,85%	0,20%	0,854%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	5,38%	3,25%	6,83%	13,03%	23,86%	0,20%	0,861%	2,97%
IDKA IPCA 2 Anos	1,37%	4,95%	3,10%	6,27%	12,05%	24,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	4,70%	2,82%	5,91%	11,05%	22,36%	0,20%	0,634%	2,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	4,60%	2,73%	5,88%	11,07%	22,22%	0,20%	0,589%	2,28%
IRF-M 1	0,68%	2,72%	1,66%	3,30%	7,19%	15,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,64%	1,61%	3,20%	7,01%	15,56%	0,20%	0,098%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	2,62%	1,59%	3,17%	6,96%	15,46%	0,10%	0,099%	0,52%
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	2,57%	1,55%	3,06%	6,22%	14,27%	0,20%	0,035%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,56%	2,61%	1,56%	3,10%	6,30%	14,39%	0,20%	0,030%	0,04%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 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	0,54%	2,55%	1,52%	3,04%	6,22%	14,24%	0,20%	0,011%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	2,54%	1,51%	3,02%	6,24%	14,47%	0,20%	0,004%	0,04%
IPCA	0,13%	2,22%	1,46%	2,37%	4,66%	7,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,72%	7,97%	4,42%	9,40%	14,14%	23,38%	0,002	1,513%	3,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,80%	5,67%	2,87%	7,27%	10,74%	22,76%	0,40%	0,985%	1,93%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,76%	5,50%	3,04%	6,80%	12,96%	-	0,40%	0,976%	2,89%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

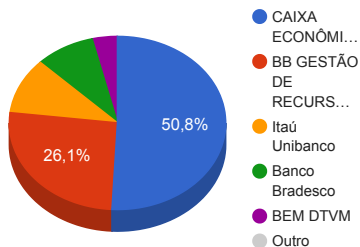
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (maio / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,70%	10,40%	1,51%	8,41%	26,42%	54,73%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2,45%	9,72%	2,86%	13,75%	30,85%	68,35%	2,50%	9,608%	20,51%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1,02%	7,31%	2,42%	7,63%	27,41%	74,34%	1,50%	8,927%	21,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,53%	2,11%	1,26%	2,96%	6,91%	-	1,60%	0,111%	2,10%

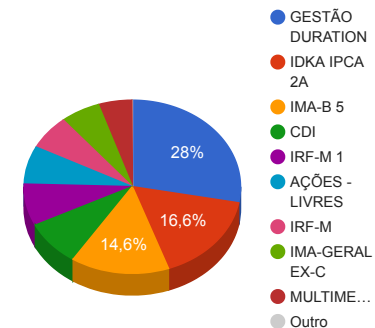
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,77%	3,45%	2,01%	3,90%	7,70%	17,89%	0,60%	0,291%	2,49%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.679.455,02	50,81%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.125.575,36	26,08%
Itaú Unibanco	4.458.005,83	10,45%
Banco Bradesco	3.787.464,87	8,88%
BEM DTVM	1.578.119,06	3,70%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	36.951,24	0,09%



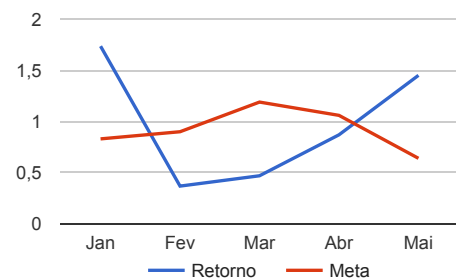
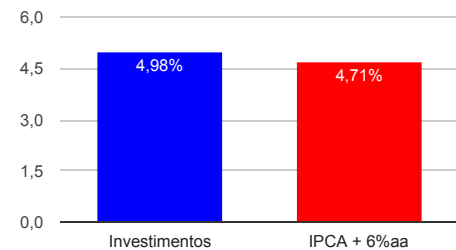
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	11.938.889,36	27,98%
IDKA IPCA 2A	7.087.063,05	16,61%
IMA-B 5	6.230.109,14	14,60%
CDI	3.615.658,36	8,47%
IRF-M 1	3.330.050,32	7,81%
AÇÕES - LIVRES	3.021.672,84	7,08%
IRF-M	2.738.671,65	6,42%
IMA-GERAL EX-C	2.529.797,48	5,93%
MULTIMERCADO	2.136.707,94	5,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	36.951,24	0,09%



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%
Acumulado no ano					1.897.122,04	4,98%	4,71%	105,92%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.000.268,64	830,67	0,00	5.136.972,44	135.873,13	2,72%	1,51%	2,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.479.763,54	0,00	0,00	2.529.797,48	50.033,94	2,02%	1,10%	2,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.523.489,05	0,00	0,00	1.550.100,50	26.611,45	1,75%	1,01%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.168.400,60	0,00	0,00	1.188.571,15	20.170,55	1,73%	1,02%	1,73%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.134.301,28	591.343,80	0,00	3.787.464,87	61.819,79	1,66%	0,98%	1,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.720.643,65	0,00	0,00	1.744.292,07	23.648,42	1,37%	0,85%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.422.171,06	3.046,74	0,00	4.485.817,07	60.599,27	1,37%	0,86%	1,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.796.418,92	0,00	0,00	4.847.441,04	51.022,12	1,06%	0,63%	1,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.982.899,54	0,00	3.014.452,05	31.552,51	1,06%	0,98%	1,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.218.626,39	0,00	0,00	2.239.622,01	20.995,62	0,95%	0,59%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.645.711,95	315.729,10	2.982.899,54	0,00	21.458,49	0,72%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.912.448,91	0,00	0,00	2.931.501,08	19.052,17	0,65%	0,10%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	395.991,89	0,00	0,00	398.549,24	2.557,35	0,65%	0,10%	0,65%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	65.317,93	0,00	0,00	65.688,87	370,94	0,57%	0,04%	0,57%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	669.930,98	0,00	0,00	673.708,85	3.777,87	0,56%	0,03%	0,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.453.950,11	0,00	48.068,12	1.413.647,82	7.765,83	0,53%	0,01%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.519.573,58	4.512,73	69.386,36	1.462.612,82	7.912,87	0,52%	0,00%	0,53%
				Total Renda Fixa	545.222,32	1,48%	0,80%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.409.006,83	0,00	0,00	1.443.553,78	34.546,95	2,45%	9,61%	2,45%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.562.219,76	0,00	0,00	1.578.119,06	15.899,30	1,02%	8,93%	1,02%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.191.374,50	0,00	0,00	1.200.601,24	9.226,74	0,77%	0,29%	0,77%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	931.146,95	0,00	0,00	936.106,70	4.959,75	0,53%	0,11%	0,53%
Total Renda Variável					64.632,74	1,27%	5,51%	