

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)

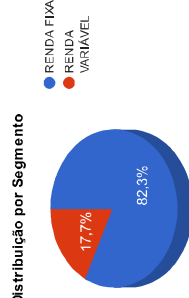
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cide. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
CAIXA BRASIL MA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D=0	Não há	1.408.932,01	9,85%	902	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D=1	Não há	773.249,08	5,40%	877	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL MA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D=0	Não há	1.144.229,36	8,00%	956	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAU SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D=0	Não há	214.718,06	1,50%	61	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D=0	Não há	996.718,29	6,97%	1.391	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D=1	Não há	1.799.139,64	12,58%	597	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D=0	Não há	1.286.744,26	8,99%	937	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D=0	Não há	42.916,51	0,30%	1.230	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D=0	Não possui	1.699.733,74	11,88%	600	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D=0	Não há	336.056,39	2,35%	96	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FC RENDA FIXA LP	D=3	Não há	671.408,80	4,69%	451	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D=0	Não há	170.338,03	1,19%	165	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FC RENDA FIXA	D=1	Não há	517.582,91	3,62%	258	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D=0	Não há	146.480,86	1,02%	326	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO A LOCAÇÃO DINÂMICA FC RENDA FIXA	D=4	Não há	564.649,73	3,95%	126	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	D=4	Não há	650.732,82	4,55%	200	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FC AÇÕES	D=24	Não há	431.626,58	3,02%	150	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAU DUNA MS FC AÇÕES	D=24 ou	Não há	164.276,51	1,15%	38.128	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D=4	Não há	1.192.942,23	8,34%	4.989	0,15%	Artigo 8º, Inciso II
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FC MULTIMERCADO LP	D=4	Não há	93.803,25	0,66%	8.060	0,00%	Artigo 8º, Inciso II
Total			14.306.279,06				

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

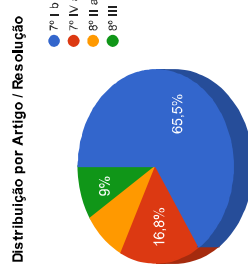
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	9.366.380,95	65,47%	15,00%	25,00%	70,00%	648.014,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	8.583.767,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	2.406.516,72	16,82%	10,00%	30,00%	40,00%	3.315.994,90
Artigo 7º, Inciso V II, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	715.313,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.246.635,91	8,71%	5,00%	10,00%	20,00%	1.614.619,90
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.286.745,48	8,99%	7,00%	10,00%	10,00%	143.882,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	715.313,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	715.313,95
Total Carteira		14.306.279,06					

RENDA FIXA	11.772.897,67	82,29%
RENDA VARIÁVEL	2.533.381,39	17,71%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea " b "	9.366.380,95	65,47%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alinea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea " a "	2.406.516,72	16,82%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V I, Alinea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso V II, Alinea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso V II, Alinea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso V II, Alinea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alinea " a "	1.246.635,91	8,71%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.286.745,18	8,99%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	14.306.279,06	100,00%	46,00	240,00

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	8.977.049,19	62,75%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.615.305,23	18,28%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.385.720,58	9,69%	0,00%
ITAU UNIBANCO	1.328.204,06	9,28%	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
IMA-B	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	16,55%	8,83%	11,64%	27,24%	35,12%	0,20%	1,344%	7,75%
IDKA FCA 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%	0,564%	1,96%
CAIXA BRASIL IDKA FCA 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%	0,7599%	2,83%
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%
FCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,94%	1,83%	5,07%	9,36%	21,07%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,91%	7,19%	3,89%	6,29%	10,73%	19,42%	0,30%	0,705%	1,38%
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,75%	3,96%	1,96%	3,41%	7,10%	14,73%	0,18%	0,107%	0,47%
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%	3,94%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	3,65%	1,63%	3,10%	6,27%	13,52%	0,20%	0,014%	0,14%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,54%	3,50%	1,52%	2,96%	6,07%	13,30%	0,20%	0,001%	0,12%

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

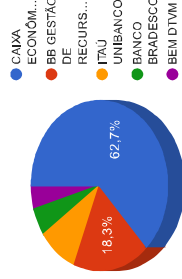
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,49%	3,15%	1,37%	2,67%	5,46%	12,01%	0,80%	0,000%	0,11%
FCA									
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,11%	12,15%	6,69%	9,01%	16,92%	25,04%	0,002	1,027%	3,40%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	9,39%	5,38%	6,85%	13,32%	22,76%	0,40%	0,570%	2,79%
	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)

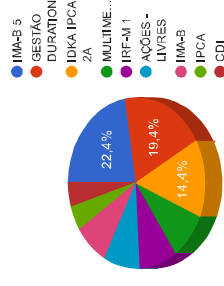
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-	-
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,95%	20,77%	12,77%	11,53%	39,89%	74,37%	2,50%	6,181%	16,97%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	3,75%	22,59%	13,05%	11,15%	39,94%	72,66%	1,90%	6,456%	15,46%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	1,72%	13,18%	6,55%	6,88%	30,34%	66,37%	1,50%	6,673%	12,86%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MAIOR FIC MULTIMERCADO LP	1,32%	11,43%	5,71%	7,47%	17,52%	27,80%	0,50%	1,150%	3,88%
CAIXA RV 30 FIMULTIMERCADO LP	0,62%	6,99%	2,83%	3,50%	12,06%	23,67%	1,00%	1,923%	4,41%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	8.977.049,19	62,75%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.615.305,23	18,28%
ITAU UNIBANCO	1.328.204,06	9,28%
BANCO BRADESCO	734.987,76	5,14%
BEM DTVM	650.732,82	4,55%



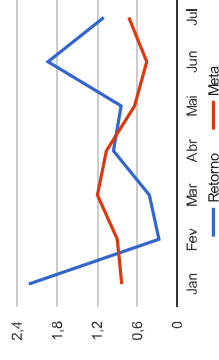
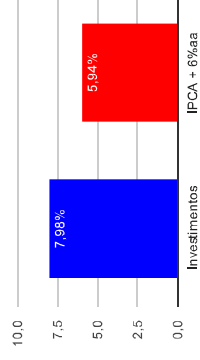
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	3.208,071,65	22,42%
GESTÃO DURATION	2.781.966,38	19,45%
IDKA IPCA 2A	2.059.993,34	14,40%
MULTIMERCADO	1.286.745,48	8,99%
IFF-M 1	1.254.352,86	8,77%
AÇÕES - LIVRES	1.246.635,91	8,71%
IMA-B	1.144.229,36	8,00%
IFCA	671.408,80	4,69%
CDI	652.875,28	4,56%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Méda (%)	Cusp (%)	VaR (%)
Janeiro	12.234.935,04	1.929.722,44	1.533.481,70	12.911.894,59	280.718,81	2,22%	0,83%	267,24%	1,34%
Fevereiro	12.911.894,59	484.541,14	325.593,95	13.105.829,50	34.987,72	0,27%	0,90%	29,89%	1,81%
Março	13.105.829,50	2.107.892,14	2.003.639,84	13.265.549,28	55.467,48	0,42%	1,19%	35,18%	2,70%
Abril	13.265.549,28	1.680.294,81	1.336.279,74	13.799.276,07	129.711,72	0,95%	1,06%	89,95%	1,40%
Maio	13.799.276,07	1.193.778,93	1.132.355,41	13.916.068,31	115.368,72	0,84%	0,64%	130,49%	1,71%
Junho	13.916.068,31	404.786,64	692.551,75	13.897.993,74	269.680,54	1,94%	0,45%	430,32%	1,80%
Julho	13.897.993,74	627.508,86	374.510,88	14.306.279,06	155.287,34	1,10%	0,72%	151,52%	1,30%
Acumulado no ano					1.041.222,33	7,98%	5,94%	134,33%	

Acumulado no Ano



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

	Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.129.838,87	0,00	0,00	1.144.229,36	14.390,49	1,27%	1,34%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA		1.591.012,64	90.893,58	0,00	1.689.733,74	17.827,52	1,06%	1,03%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		765.728,25	0,00	0,00	773.249,08	7.520,83	0,98%	0,58%	0,98%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA		512.725,71	0,00	0,00	517.582,91	4.857,20	0,95%	0,57%	0,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.395.711,93	0,00	0,00	1.408.932,01	13.220,08	0,95%	0,75%	0,95%
BB IMA-B 5 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		1.696.110,19	86.162,34	0,00	1.799.139,64	16.867,11	0,95%	0,76%	0,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.275.046,72	0,00	0,00	1.286.744,26	11.697,54	0,92%	0,58%	0,92%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FI RENDA FIXA LP		665.374,88	0,00	0,00	671.408,80	6.033,92	0,91%	0,70%	0,91%
ITAU SOBERANO IRR-M 1 FI RENDA FIXA		213.124,69	0,00	0,00	214.718,06	1.593,37	0,75%	0,11%	0,75%
BB IRR-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		42.618,52	0,00	0,00	42.916,51	297,99	0,70%	0,12%	0,70%
CAIXA BRASIL IRR-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		1.288.524,25	0,00	300.000,00	986.718,29	8.194,04	0,64%	0,12%	0,70%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA		261.230,35	300.000,00	0,00	564.649,73	3.419,38	0,61%	0,65%	0,93%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		334.183,95	0,00	0,00	336.056,39	1.872,44	0,56%	0,01%	0,56%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA		169.418,29	0,00	0,00	170.338,03	919,74	0,54%	0,00%	0,54%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA		69.870,74	150.452,94	74.510,88	146.480,86	668,06	0,30%	0,00%	0,49%
				Total Renda Fixa		109.379,71	0,94%	0,70%	

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

	Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES		411.282,71	0,00	0,00	431.626,58	20.343,87	4,95%	6,18%	4,95%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES		158.337,39	0,00	0,00	164.276,51	5.939,12	3,75%	6,46%	3,75%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES		639.711,78	0,00	0,00	650.732,82	11.021,04	1,72%	6,67%	1,72%
CAIXA A LOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP		92.577,23	0,00	0,00	93.803,25	1.226,02	1,32%	1,15%	1,32%
CAIXA RV 30 FIC MULTIMERCADO LP		1.185.564,65	0,00	0,00	1.192.942,23	7.377,58	0,62%	1,92%	0,62%
	Total Renda Variável					45.907,63	1,85%	4,13%	