

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)

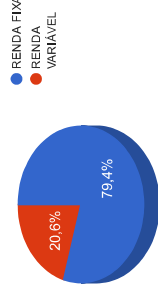
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
BB IDXA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	523.553,36	3,63%	875	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.139.389,23	7,90%	962	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO RF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	133.697,84	0,93%	64	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IFF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.001.950,71	6,94%	1.390	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.885.329,57	13,07%	605	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDXA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.288.031,40	8,93%	940	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB RF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	43.138,36	0,30%	1.214	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.409.423,96	9,77%	915	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.697.532,53	11,76%	630	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	237.421,71	1,65%	95	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	671.634,46	4,65%	480	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	171.154,15	1,19%	182	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	547.455,53	3,79%	271	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	143.690,94	1,00%	333	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO A LOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+4	Não há	565.237,53	3,92%	136	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	666.688,72	4,63%	203	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	438.436,96	3,04%	151	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAIMS FI AÇÕES	D+24 du	Não há	317.747,41	2,20%	46.226	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FI AÇÕES	D+25 du	Não há	196.441,84	1,36%	2.340	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.196.456,40	8,29%	5.330	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MA GRO FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	152.616,32	1,06%	10.173	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
Total		Total	14.429.028,93				

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

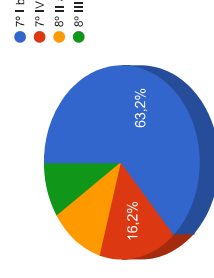
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	9.122,046,96	63,22%	15,00%	25,00%	70,00%	978,273,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	8.657,417,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	2.336,594,32	16,19%	10,00%	30,00%	40,00%	3.435,017,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	721,451,45
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.621,314,93	11,24%	5,00%	10,00%	20,00%	1.264,490,68
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.349,072,72	9,35%	7,00%	10,00%	10,00%	93,830,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	721,451,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	721,451,45
Total Carteira		14.429,028,93					

RENDA FIXA	11.458.641,28	79,41%
RENDA VARIÁVEL	2.970.387,65	20,59%

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 " b "	9.122.046,96	63,22%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.336.594,32	16,19%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
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 "	1.621.314,93	11,24%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.349.072,72	9,35%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	14.429.028,93	100,00%	46,00	240,00

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	8.938.147,66	61,95%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.452.021,29	16,99%	0,00%
ITAU UNIBANCO	1.437.337,74	9,96%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.405.080,40	9,74%	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
FCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,60%	1,81%	4,78%	9,56%	20,95%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FC RENDA FIXA LP	0,03%	7,23%	2,56%	5,74%	10,48%	18,23%	0,30%	1,036%	1,50%
RF-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 FC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,10%	0,181%	0,47%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,47%	4,45%	1,80%	3,40%	7,18%	14,26%	0,18%	0,183%	0,44%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA A LIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	4,15%	1,54%	3,12%	6,22%	13,17%	0,20%	0,022%	0,14%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,48%	3,99%	1,48%	2,97%	6,00%	12,97%	0,20%	0,003%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	3,60%	1,33%	2,68%	5,40%	11,68%	0,80%	0,003%	0,10%
FCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FC RENDA FIXA	0,32%	9,73%	3,85%	6,83%	13,26%	21,71%	0,40%	0,534%	2,80%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FC 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 ICA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA ICA 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%
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%

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

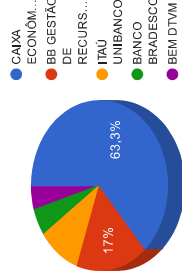
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5									
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	8,22%	2,70%	6,03%	14,23%	21,57%	0,20%	1,039%	2,82%
	0,03%	8,23%	2,72%	6,06%	14,19%	21,56%	0,20%	1,022%	2,79%
IMA-B									
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
	-0,42%	16,06%	4,57%	10,60%	27,30%	32,79%	0,20%	2,483%	7,74%

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

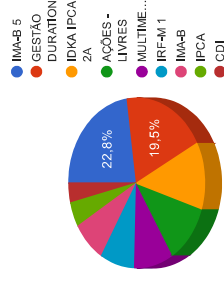
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	Var - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA A LOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,61%	12,10%	4,31%	8,13%	18,20%	26,34%	0,50%	2,028%	3,71%
CAIXA RV 30 FIC MULTIMERCADO LP	0,29%	7,31%	2,42%	4,13%	13,09%	20,78%	1,00%	3,409%	4,14%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2,76%	16,31%	8,38%	11,01%	37,16%	59,21%	1,50%	13,022%	11,82%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,58%	22,68%	11,81%	15,00%	47,57%	64,39%	2,50%	11,807%	15,46%
ITAU DYNAMIS FIC AÇÕES	1,57%	24,51%	12,99%	14,33%	46,36%	62,65%	1,90%	11,003%	14,25%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,74%	-	-	-	-	-	1,50%	10,757%	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.134.589,50	63,31%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.452.021,29	16,89%
ITAU UNIBANCO	1.437.337,74	9,96%
BANCO BRADESCO	736.391,68	5,10%
BEM DTVM	688.688,72	4,63%



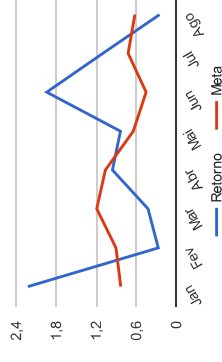
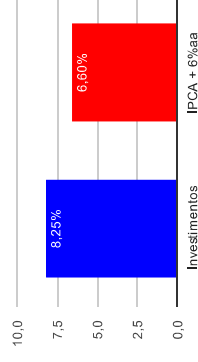
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	3.294.753,53	22,83%
GESTÃO DURATION	2.810.225,59	19,48%
IDKA IPCA 2A	1.811.584,76	12,56%
AÇÕES - LIVRES	1.621.314,93	11,24%
MULTIMERCADO	1.349.072,72	9,35%
IRF-M 1	1.178.786,91	8,17%
IMA-B	1.139.389,23	7,90%
IPCA	671.634,46	4,65%
CDI	552.266,80	3,83%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	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	1.860.294,81	1.336.279,74	13.739.276,07	129.711,72	0,95%	1,06%	89,95%	1,40%
Mai	13.739.276,07	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	404.796,64	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%
Agosto	14.306.279,06	629.373,22	542.332,63	14.429.028,93	35.709,28	0,25%	0,62%	39,98%	2,51%
Acumulado no ano					1.076.931,61	8,25%	6,60%	125,00%	

Acumulado no Ano



Retorno dos investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2019

	Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		996.718,29	0,00	0,00	1.001.950,71	5.232,42	0,52%	0,18%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		42.916,51	0,00	0,00	43.138,36	221,85	0,52%	0,18%	0,52%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA		170.338,03	0,00	0,00	171.154,15	816,12	0,48%	0,00%	0,48%
ITAU SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA		214.718,06	0,00	82.000,00	133.697,84	979,78	0,46%	0,18%	0,47%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		336.066,39	0,00	100.000,00	237.421,71	1.365,32	0,41%	0,02%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA		146.480,86	21.095,51	24.496,14	143.690,94	610,71	0,36%	0,00%	0,43%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FC RENDA FIXA		517.582,91	28.220,46	0,00	547.455,53	1.652,16	0,30%	0,53%	0,32%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FC RENDA FIXA		564.649,73	0,00	0,00	565.237,53	587,80	0,10%	1,10%	0,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.286.744,26	0,00	0,00	1.288.031,40	1.287,14	0,10%	0,74%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		773.249,08	0,00	250.000,00	523.553,36	304,28	0,04%	0,71%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.408.932,01	0,00	0,00	1.409.423,96	491,95	0,03%	1,04%	0,03%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FC RENDA FIXA LP		671.408,80	0,00	0,00	671.634,46	225,66	0,03%	1,04%	0,03%
BB IMA-B 5 FC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		1.799.139,64	85.836,49	0,00	1.885.329,57	353,44	0,02%	1,02%	0,03%
BB FLUXO FC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		0,00	85.820,92	85.836,49	0,00	15,57	0,02%	0,00%	0,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA		1.699.733,74	0,00	0,00	1.697.532,53	-2.201,21	-0,13%	1,74%	-0,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.144.229,36	0,00	0,00	1.139.389,23	-4.840,13	-0,42%	2,48%	-0,42%
				Total Renda Fixa		7.102,86	0,06%	1,08%	

Retorno dos investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2019

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	650.732,82	0,00	0,00	668.688,72	17.955,90	2,76%	13,02%	2,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	431.626,58	0,00	0,00	438.436,96	6.810,38	1,58%	11,81%	1,58%
ITAÚ DUNA MIS FIC AÇÕES	164.276,51	150.000,00	0,00	317.747,41	3.470,90	1,10%	11,00%	1,57%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.192.942,23	0,00	0,00	1.196.456,40	3.514,17	0,29%	3,41%	0,29%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	93.803,25	58.399,84	0,00	152.616,32	413,23	0,27%	2,03%	0,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	196.441,84	-3.558,16	-1,78%	10,76%	-0,74%
				Total Renda Variável	28.606,42	0,97%	8,04%	