

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)

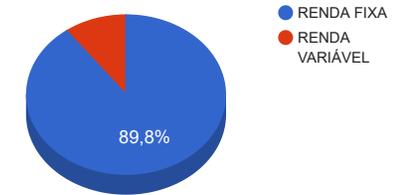
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.558.406,47	7,65%	937	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.355.536,88	0,98%	651	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.068.914,65	6,57%	517	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	25.254.292,16	18,31%	1.230	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.535.260,90	5,46%	877	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	462.007,97	0,33%	115	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	742.195,37	0,54%	119	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.947.180,54	2,86%	45	2,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.834.547,58	4,23%	1.391	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	25.859.409,80	18,74%	902	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	15.484.809,46	11,22%	784	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.063.623,18	2,22%	720	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	11.435.368,11	8,29%	724	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ILLUMINATI FIDC	D+1 ou D+1260	30 dias	3.241.854,33	2,35%	11	1,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	3.238.602,20	2,35%	14	1,58%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.224.976,00	1,61%	729	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	4.226.174,58	3,06%	955	0,87%	Artigo 8º, Inciso III
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.804.580,54	1,31%	17	8,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	Não se aplica	Não se aplica	2.610.355,63	1,89%		6,98%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			137.948.096,35				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			9.727,96				Artigo 6º
Total			137.957.824,31				

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

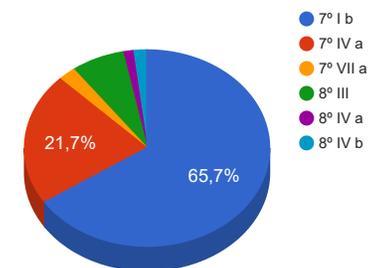
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90.617.752,32	65,69%	15,00%	25,00%	70,00%	5.945.915,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	82.768.857,81
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	29.983.800,75	21,74%	10,00%	30,00%	40,00%	25.195.437,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.241.854,33	2,35%	2,00%	5,00%	5,00%	3.655.550,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	27.589.619,27
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.689.752,78	7,02%	7,00%	10,00%	10,00%	4.105.056,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.804.580,54	1,31%	2,00%	5,00%	5,00%	5.092.824,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.610.355,63	1,89%	2,00%	5,00%	5,00%	4.287.049,19
Total Carteira		137.948.096,35					

RENDA FIXA	123.853.135,36	89,78%
RENDA VARIÁVEL	14.104.688,95	10,22%

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, Alínea " b "	90.617.752,32	65,69%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	29.983.800,75	21,73%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.241.854,33	2,35%	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 "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.689.752,78	7,02%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.804.580,54	1,31%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.610.355,63	1,89%	0,00%	5,00%
Total	137.948.096,35	99,99%	30,00	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	64.188.323,89	46,53%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.864.379,76	45,57%	0,00%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.043.182,74	3,66%	1,14%
Queluz Gestão de Recursos	3.241.854,33	2,35%	-
ROMA ASSET	2.610.355,63	1,89%	2,14%

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%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	16,50%	8,84%	11,64%	27,11%	34,97%	0,20%	1,342%	7,68%
IDKA IPCA 3 Anos	1,12%	9,48%	5,18%	7,62%	16,12%	26,43%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	9,32%	4,59%	7,25%	16,17%	25,45%	0,20%	0,875%	4,03%
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%	-	-	-
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%
IPCA + 8,50% ao ano	0,94%	7,38%	2,43%	6,28%	11,92%	26,80%	-	-	-
ILLUMINATI FIDC	-1,26%	-9,78%	1,02%	10,26%	-8,90%	-1,58%	1,50%	1,460%	21,17%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,94%	1,83%	5,07%	9,36%	21,07%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	8,75%	4,22%	6,81%	15,25%	32,93%	0,20%	0,792%	3,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	5,13%	1,91%	4,04%	9,55%	18,50%	0,15%	0,382%	1,54%
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-

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

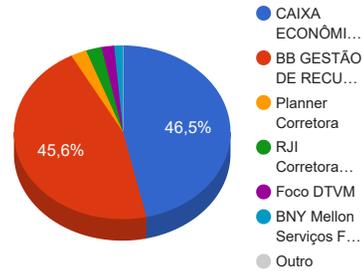
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	3,95%	1,94%	3,37%	7,11%	14,84%	0,20%	0,124%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL 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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	3,01%	1,31%	2,55%	5,21%	11,47%	1,00%	0,005%	0,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

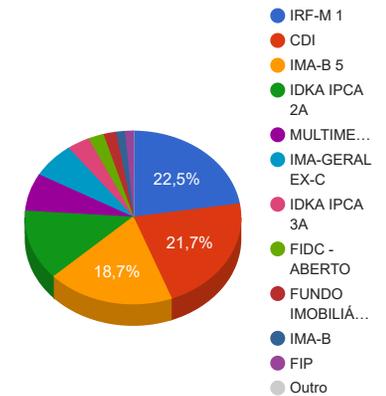
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,76%	5,08%	2,96%	4,05%	-	-	1,60%	0,296%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,53%	3,15%	1,55%	2,58%	7,07%	-	1,60%	0,099%	1,79%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,94%	1,83%	5,07%	9,36%	21,07%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,21%	-8,25%	-4,93%	-8,07%	-	-9,32%	1,50%	0,066%	5,07%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	1,50%	0,000%	0,00%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	0,025%	0,10%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	64.188.323,89	46,53%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.864.379,76	45,57%
Planner Corretora	3.241.854,33	2,35%
RJI Corretora de Valores	3.238.602,20	2,35%
Foco DTVM	2.610.355,63	1,89%
BNY Mellon Serviços Financeiros	1.804.580,54	1,31%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	9.727,96	0,01%



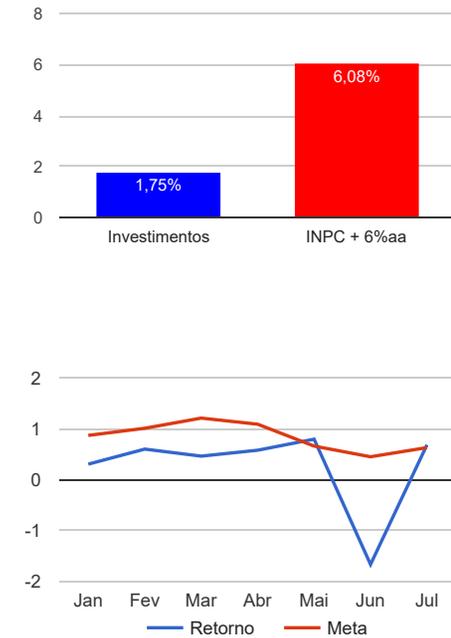
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	31.088.839,74	22,54%
CDI	29.983.800,75	21,73%
IMA-B 5	25.859.409,80	18,74%
IDKA IPCA 2A	18.093.667,37	13,12%
MULTIMERCADO	9.689.752,78	7,02%
IMA-GERAL EX-C	9.068.914,65	6,57%
IDKA IPCA 3A	4.689.375,91	3,40%
FIDC - ABERTO	3.241.854,33	2,35%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.610.355,63	1,89%
IMA-B	1.817.544,85	1,32%
FIP	1.804.580,54	1,31%
DISP. FINANCEIRA	9.727,96	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	134.553.696,18	679.903,12	571.250,18	135.073.206,15	410.857,03	0,31%	0,87%	35,00%	0,29%
Fevereiro	135.073.206,15	371.581,40	219.697,75	136.037.169,19	812.079,39	0,60%	1,01%	59,69%	0,44%
Março	136.037.169,19	546.490,73	102.315,61	137.112.473,11	631.128,80	0,46%	1,21%	38,10%	0,47%
Abril	137.112.473,11	193.717,68	110.503,51	137.989.290,35	793.603,07	0,58%	1,09%	53,08%	0,28%
Mai	137.989.290,35	328.083,05	253.661,42	139.162.493,10	1.098.781,12	0,80%	0,66%	120,45%	0,31%
Junho	139.162.493,10	20.214.614,39	20.142.698,36	136.914.663,90	-2.319.745,23	-1,67%	0,45%	-369,96%	0,74%
Julho	136.914.663,90	458.884,07	363.341,90	137.948.096,35	937.890,28	0,68%	0,63%	108,01%	0,38%
Acumulado no ano					2.364.594,46	1,75%	6,08%	28,82%	

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.338.488,37	0,00	0,00	1.355.536,88	17.048,51	1,27%	1,34%	1,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.977.600,38	0,00	0,00	9.068.914,65	91.314,27	1,02%	0,70%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.907.927,44	0,00	0,00	3.947.180,54	39.253,10	1,00%	0,88%	1,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.461.970,92	0,00	0,00	7.535.260,90	73.289,98	0,98%	0,58%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	457.573,78	0,00	0,00	462.007,97	4.434,19	0,97%	0,79%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.608.467,63	8.314,75	0,00	25.859.409,80	242.627,42	0,95%	0,75%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.462.422,08	0,00	0,00	10.558.406,47	95.984,39	0,92%	0,58%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	736.760,74	0,00	0,00	742.195,37	5.434,63	0,74%	0,38%	0,74%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.793.997,00	0,00	0,00	5.834.547,58	40.550,58	0,70%	0,12%	0,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.327.182,51	0,00	250.000,00	25.254.292,16	177.109,65	0,70%	0,12%	0,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.400.049,61	0,00	0,00	15.484.809,46	84.759,85	0,55%	0,00%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.372.910,42	0,00	0,00	11.435.368,11	62.457,69	0,55%	0,00%	0,55%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.713.490,65	450.569,32	113.341,90	3.063.623,18	12.905,11	0,41%	0,00%	0,47%
ILLUMINATI FIDC	3.283.128,61	0,00	0,00	3.241.854,33	-41.274,28	-1,26%	1,46%	-0,96%
Total Renda Fixa					905.895,09	0,74%	0,41%	

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(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	4.194.250,40	0,00	0,00	4.226.174,58	31.924,18	0,76%	0,30%	0,76%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.213.274,00	0,00	0,00	2.224.976,00	11.702,00	0,53%	0,10%	0,53%
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	2.611.735,28	0,00	0,00	2.610.355,63	-1.379,65	-0,05%	0,00%	0,00%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.807.899,16	0,00	0,00	1.804.580,54	-3.318,62	-0,18%	0,03%	-0,18%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.245.534,92	0,00	0,00	3.238.602,20	-6.932,72	-0,21%	0,07%	-0,21%
Total Renda Variável					31.995,19	0,23%	0,12%	