

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2019)

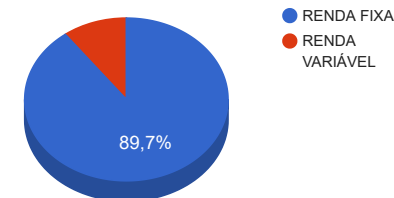
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.920.759,73	2,82%	45	2,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.917.219,28	4,26%	1.389	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	728.500,02	0,52%	119	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.645.677,25	5,50%	876	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.211.152,76	15,27%	1.212	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	458.217,41	0,33%	115	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.212.651,56	6,63%	552	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.388.346,76	1,00%	681	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.719.516,59	7,72%	937	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	26.313.407,89	18,94%	913	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	15.630.098,46	11,25%	758	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	10.804.706,85	7,78%	695	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.033.565,57	2,90%		0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.364.607,42	2,42%	729	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ILLUMINATI FIDC	D+1 ou D+1260	30 dias	3.300.305,71	2,38%	11	1,39%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	1.000.000,00	0,72%	55.951	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.242.494,00	1,61%	729	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	4.277.334,90	3,08%	955	0,87%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	3.182.185,12	2,29%	14	1,58%	Artigo 8º, Inciso III
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.796.308,52	1,29%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SÃO DOMINGOS FII - FID11	Não se aplica	Não se aplica	1.745.490,97	1,26%		4,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			138.892.546,77				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			10.161,90				Artigo 6º
Página 1			Total	138.902.708,67			

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

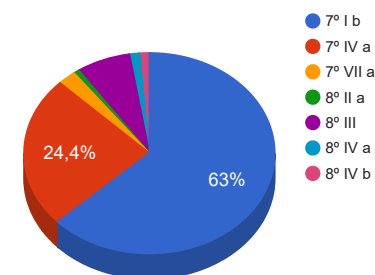
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	87.515.449,25	63,01%	15,00%	25,00%	70,00%	9.709.333,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	83.335.528,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	33.832.978,30	24,36%	10,00%	30,00%	40,00%	21.724.040,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.300.305,71	2,38%	2,00%	5,00%	5,00%	3.644.321,63
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.000.000,00	0,72%	7,00%	10,00%	20,00%	26.778.509,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.702.014,02	6,99%	7,00%	10,00%	10,00%	4.187.240,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.796.308,52	1,29%	2,00%	5,00%	5,00%	5.148.318,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.745.490,97	1,26%	2,00%	5,00%	5,00%	5.199.136,37
Total Carteira		138.892.546,77					

RENDA FIXA	124.658.895,16	89,75%
RENDA VARIÁVEL	14.243.813,51	10,26%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	87.515.449,25	63,00%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	33.832.978,30	24,36%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.300.305,71	2,38%	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 "	1.000.000,00	0,72%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.702.014,02	6,98%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.796.308,52	1,29%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.745.490,97	1,26%	0,00%	5,00%
Total	138.892.546,77	99,99%	30,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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	65.100.071,12	46,87%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.734.619,76	42,28%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	5.033.565,57	3,62%	0,00%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	4.978.493,64	3,58%	1,13%
Queluz Gestão de Recursos	3.300.305,71	2,38%	-
ROMA ASSET	1.745.490,97	1,26%	23,00%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '1043' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rf.asp, line 62