

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)

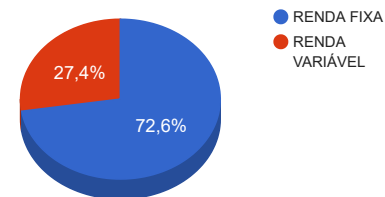
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
							3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.596.442,90	19,31%	630	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.067.028,43	7,80%	1.214	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	395.955,21	1,01%	1.390	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.388.465,52	11,16%	875	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.955.557,30	4,97%	940	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.107.117,29	2,81%	6	3,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.401.486,80	3,56%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	597.759,31	1,52%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.209.489,48	3,08%	701	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.649.702,73	6,74%	733	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.945.493,21	4,95%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	22.320,34	0,06%	98	0,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.098.513,45	5,34%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	107.390,27	0,27%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.871.992,08	4,76%	5.990	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	747.061,37	1,90%	2.016	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.417.760,35	6,15%	127	1,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	829.557,74	2,11%	4.313	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.642.049,40	6,72%	77	1,79%	Artigo 8º, Inciso III
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	1.319.100,10	3,35%		0,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
OSASCO PROPERTIES FII	Não se aplica	Não se aplica	959.662,53	2,44%		0,23%	Desenquadrado - RV
Total			39.329.905,81				

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

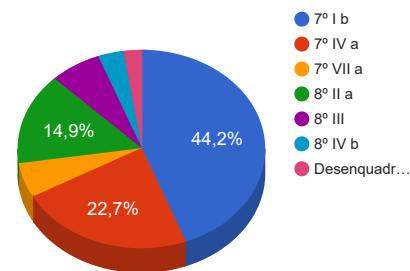
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.403.449,36	44,25%	15,00%	25,00%	95,00%	19.959.961,16
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	23.597.943,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.911.048,82	22,66%	10,00%	20,00%	40,00%	6.820.913,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.228.224,06	5,67%	0,00%	5,00%	5,00%	-261.728,77
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	7.865.981,16
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	5.866.371,54	14,92%	0,00%	10,00%	20,00%	1.999.609,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.642.049,40	6,72%	0,00%	10,00%	10,00%	1.290.941,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.966.495,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.319.100,10	3,35%	0,00%	5,00%	5,00%	647.395,19
Desenquadrado - RV	0,00%	959.662,53	2,44%	0,00%	0,00%	0,00%	-959.662,53
Total Carteira		39.329.905,81					

RENDA FIXA	28.542.722,24	72,57%
RENDA VARIÁVEL	10.787.183,57	27,43%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	17.403.449,36	44,25%	15,00%	95,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	8.911.048,82	22,66%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.228.224,06	5,67%	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 I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	5.866.371,54	14,92%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.642.049,40	6,72%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.319.100,10	3,35%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	959.662,53	2,44%	0,00%	0,00%
Total	39.329.905,81	100,00%	25,00	290,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.314.686,16	28,77%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.947.955,41	25,29%	0,00%
Elleven Gestora de Recursos	3.650.369,81	9,28%	0,20%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	2.642.049,40	6,72%	0,38%
META ASSET MANAGEMENT	2.417.760,35	6,15%	1,10%
Aurora Capital	2.098.513,45	5,34%	1,03%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	1.871.992,08	4,76%	0,26%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	1.508.877,07	3,84%	0,92%
MÉRITO INVESTIMENTOS	1.319.100,10	3,35%	-
CADENCE GESTORA	959.662,53	2,44%	-
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	829.557,74	2,11%	0,02%
PERFIN INVESTIMENTOS	747.061,37	1,90%	0,01%
PETRA Capital	22.320,34	0,06%	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
IPCA + 7,00% ao ano	0,70%	7,27%	2,05%	5,27%	10,58%	23,22%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	2,60%	0,97%	1,71%	4,66%	1,32%	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-5,63%	-11,25%	-4,67%	-6,38%	-5,14%	-24,90%	1,65%	19,015%	13,14%

IRF-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 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,10%	0,181%	0,47%

CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,08%	1,51%	3,03%	6,16%	13,44%	0,20%	0,008%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	3,43%	1,26%	2,55%	5,15%	11,14%	1,00%	0,005%	0,10%

101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,46%	5,33%	1,33%	3,84%	7,63%	16,72%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,18%	-8,51%	-6,50%	-8,23%	-9,37%	-14,41%	0,15%	0,055%	49,05%

IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
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 IPCA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 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%

IMA-B 5	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
---------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

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

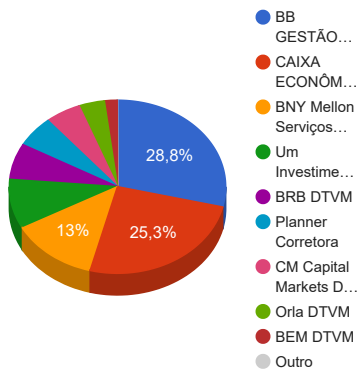
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,37%	2,27%	0,68%	0,72%	2,10%	-6,75%	0,70%	1,224%	4,67%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,43%	7,97%	1,57%	5,43%	10,48%	-	0,70%	1,632%	2,45%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,44%	1,80%	3,21%	1,55%	4,11%	-17,07%	0,70%	0,936%	4,75%
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,16%	9,19%	2,33%	5,80%	15,46%	-	0,00%	1,185%	5,44%

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

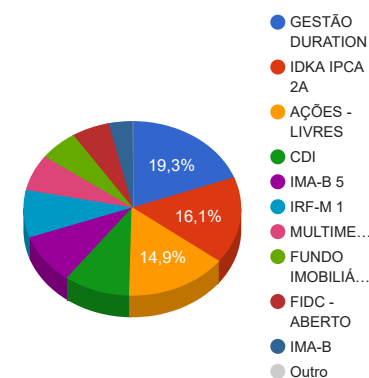
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,23%	4,36%	1,45%	3,12%	6,54%	14,32%	1,00%	0,287%	0,50%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	1,64%	17,27%	8,82%	8,21%	38,65%	47,34%	2,00%	11,921%	14,72%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,98%	25,56%	11,64%	13,96%	51,68%	64,41%	2,00%	10,320%	19,09%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,72%	18,02%	4,29%	10,01%	42,92%	40,49%	1,85%	7,344%	12,54%
IBX	-0,16%	16,75%	5,14%	7,34%	34,86%	44,77%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-2,62%	10,71%	6,76%	3,06%	33,11%	48,45%	2,50%	13,671%	18,16%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,24%	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	-2,11%	28,27%	6,04%	9,57%	0,25%	3,74%	0,15%	5,407%	42,22%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.314.686,16	28,77%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.947.955,41	25,29%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.119.310,17	13,02%
Um Investimentos	3.650.369,81	9,28%
BRB DTVM	2.642.049,40	6,72%
Planner Corretora	2.278.762,63	5,79%
CM Capital Markets DTVM	2.098.513,45	5,34%
Orla DTVM	1.508.877,07	3,84%
BEM DTVM	747.061,37	1,90%
FINAXIS Corretora	22.320,34	0,06%



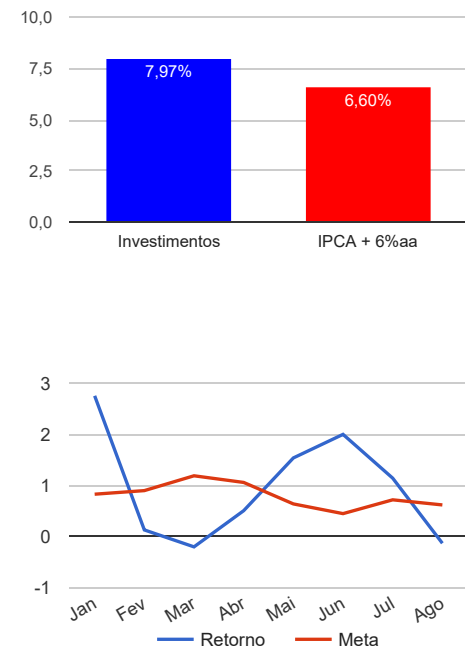
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	7.596.442,90	19,31%
IDKA IPCA 2A	6.344.022,82	16,13%
AÇÕES - LIVRES	5.866.371,54	14,92%
CDI	3.859.192,21	9,81%
IMA-B 5	3.650.369,81	9,28%
IRF-M 1	3.462.983,64	8,80%
MULTIMERCADO	2.642.049,40	6,72%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.278.762,63	5,79%
FIDC - ABERTO	2.205.903,72	5,61%
IMA-B	1.401.486,80	3,56%
FIDC - FECHADO	22.320,34	0,06%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	33.327.623,54	1.236.084,20	408.259,20	35.096.126,06	940.677,52	2,75%	0,83%	331,17%	2,36%
Fevereiro	35.096.126,06	1.006.601,84	418.437,06	35.731.138,29	46.847,45	0,13%	0,90%	14,66%	2,35%
Março	35.731.138,29	669.182,76	357.242,09	35.971.016,17	-72.062,79	-0,20%	1,19%	-16,75%	3,92%
Abril	35.971.016,17	743.322,48	429.640,01	36.468.886,38	184.187,74	0,51%	1,06%	47,91%	1,66%
Mai	36.468.886,38	733.203,49	446.513,65	37.321.261,69	565.685,47	1,54%	0,64%	240,23%	5,11%
Junho	37.321.261,69	735.757,94	452.155,51	38.357.002,91	752.138,79	2,00%	0,45%	444,13%	2,06%
Julho	38.357.002,91	737.469,32	447.675,46	39.088.748,65	441.951,88	1,14%	0,72%	157,90%	1,78%
Agosto	39.088.748,65	839.793,80	547.579,29	39.329.905,81	-51.057,35	-0,13%	0,62%	-20,89%	3,66%
Acumulado no ano					2.808.368,71	7,97%	6,60%	120,83%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	393.887,43	0,00	0,00	395.955,21	2.067,78	0,52%	0,18%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.051.255,44	0,00	0,00	3.067.028,43	15.772,99	0,52%	0,18%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.203.557,93	0,00	0,00	1.209.489,48	5.931,55	0,49%	0,01%	0,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.399.193,17	660.508,36	421.394,76	2.649.702,73	11.395,96	0,37%	0,00%	0,41%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.953.603,11	0,00	0,00	1.955.557,30	1.954,19	0,10%	0,74%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.386.172,15	0,00	0,00	4.388.465,52	2.293,37	0,05%	0,71%	0,05%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.223.651,12	0,00	126.184,53	2.098.513,45	1.046,86	0,05%	19,02%	-5,63%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	107.355,61	0,00	0,00	107.390,27	34,66	0,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.428.033,05	179.285,44	0,00	7.596.442,90	-10.875,59	-0,14%	1,74%	-0,13%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.403.738,75	0,00	0,00	1.401.486,80	-2.251,95	-0,16%	1,18%	-0,18%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	22.360,64	0,00	0,00	22.320,34	-40,30	-0,18%	0,06%	-0,33%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	599.971,38	0,00	0,00	597.759,31	-2.212,07	-0,37%	1,22%	-0,37%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.111.951,06	0,00	0,00	1.107.117,29	-4.833,77	-0,43%	1,63%	-0,43%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.954.129,50	0,00	0,00	1.945.493,21	-8.636,29	-0,44%	0,94%	-0,44%
Total Renda Fixa					11.647,39	0,04%	2,26%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	816.155,83	0,00	0,00	829.557,74	13.401,91	1,64%	11,92%	1,64%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.853.750,98	0,00	0,00	1.871.992,08	18.241,10	0,98%	10,32%	0,98%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.636.058,65	0,00	0,00	2.642.049,40	5.990,75	0,23%	0,29%	0,23%
OSASCO PROPERTIES FII	961.054,50	0,00	0,00	959.662,53	-1.391,97	-0,14%	-	0,00%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	752.485,05	0,00	0,00	747.061,37	-5.423,68	-0,72%	7,34%	-0,72%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	1.347.516,59	0,00	0,00	1.319.100,10	-28.416,49	-2,11%	5,41%	-2,11%
META VALOR FI AÇÕES	2.482.866,71	0,00	0,00	2.417.760,35	-65.106,36	-2,62%	13,67%	-2,62%
Total Renda Variável					-62.704,74	-0,58%	7,70%	