

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 2019)

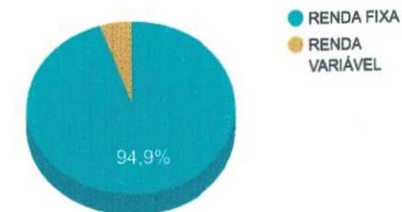
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.510,91	0,01%			Artigo 20
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.584.469,53	11,05%	546	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.956.736,87	20,61%	897	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	358.126,04	2,50%	588	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.985.341,85	13,84%	864	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	346.877,95	2,42%	1.253	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.064.428,86	14,39%	866	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	189.909,32	1,32%	1.439	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	494.998,84	3,45%	104	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	113.514,52	0,79%	110	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.613.083,30	11,24%	33	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	935.939,54	6,52%	513	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	60.826,36	0,42%	165.085	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	907.452,00	6,33%	722	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	324.319,77	2,26%	4.424	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	407.833,86	2,84%		0,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			14.345.369,52				

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

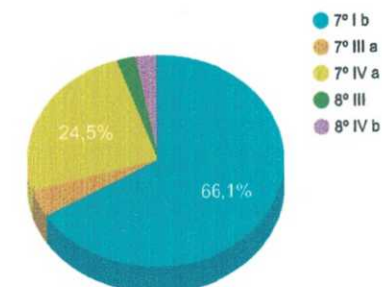
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	9.485.890,42	66,13%	20,00%	30,00%	80,00%	1.990.405,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	608.513,36	4,24%	5,00%	10,00%	60,00%	7.998.708,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	3.517.301,20	24,52%	10,00%	30,00%	40,00%	2.220.846,61
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	2.869.073,90
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	324.319,77	2,26%	0,00%	10,00%	10,00%	1.110.217,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	407.833,86	2,84%	0,00%	5,00%	5,00%	309.434,62
Total Carteira		14.343.858,61					

RENDA FIXA	13.613.215,89	94,91%
RENDA VARIÁVEL	732.153,63	5,10%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	9.485.890,42	66,13%	20,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	608.513,36	4,24%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.517.301,20	24,52%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
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	324.319,77	2,26%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	407.833,86	2,84%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	14.343.858,61	99,99%	35,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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	6.392.247,35	44,56%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.322.180,74	37,10%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	1.613.083,30	11,24%	0,23%
SICREDI	608.513,36	4,24%	0,00%
ZION Invest	407.833,86	2,84%	0,08%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,20%	15,29%	7,55%	17,45%	32,56%	42,12%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,61%	3,98%	1,83%	4,80%	11,55%	23,97%	0,50%	-	-
IMA-B	3,66%	11,06%	5,83%	12,89%	23,73%	34,52%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,64%	10,74%	5,72%	12,60%	23,31%	33,79%	0,20%	2,128%	5,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,63%	10,92%	5,76%	12,71%	23,36%	33,78%	0,20%	2,156%	5,82%
IRF-M	1,77%	4,72%	2,99%	6,33%	13,33%	25,08%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	1,82%	4,75%	3,01%	6,32%	13,45%	25,05%	0,20%	1,076%	3,44%
IMA-B 5	1,39%	5,47%	3,31%	6,91%	13,22%	24,34%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,37%	5,37%	3,25%	6,79%	12,98%	23,85%	0,20%	0,854%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	5,38%	3,25%	6,83%	13,03%	23,86%	0,20%	0,861%	2,97%
IDKA IPCA 2 Anos	1,37%	4,95%	3,10%	6,27%	12,05%	24,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	4,70%	2,82%	5,91%	11,05%	22,36%	0,20%	0,634%	2,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	4,60%	2,73%	5,88%	11,07%	22,22%	0,20%	0,589%	2,28%
IRF-M 1	0,68%	2,72%	1,66%	3,30%	7,19%	15,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,64%	1,61%	3,20%	7,01%	15,56%	0,20%	0,098%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	2,62%	1,59%	3,17%	6,96%	15,46%	0,10%	0,099%	0,52%
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-

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

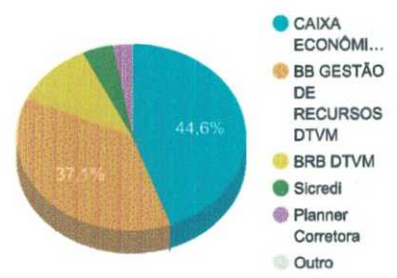
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	2,14%	1,27%	2,55%	5,24%	12,12%	1,00%	0,002%	0,01%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,19%	0,90%	0,54%	1,08%	2,20%	5,78%	4,00%	0,004%	0,01%
IPCA	0,13%	2,22%	1,46%	2,37%	4,66%	7,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,72%	7,97%	4,42%	9,40%	14,14%	23,38%	0,002	1,513%	3,44%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

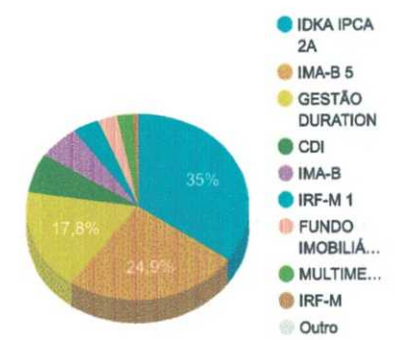
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,70%	4,77%	1,67%	4,49%	11,33%	24,80%	1,00%	2,622%	6,31%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,25%	-13,37%	-12,35%	-19,02%	-23,59%	-6,88%	1,60%	27,309%	70,94%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.392.247,35	44,56%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.322.180,74	37,10%
BRB DTVM	1.613.083,30	11,24%
Sicredi	608.513,36	4,24%
Planner Corretora	407.833,86	2,84%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.510,91	0,01%



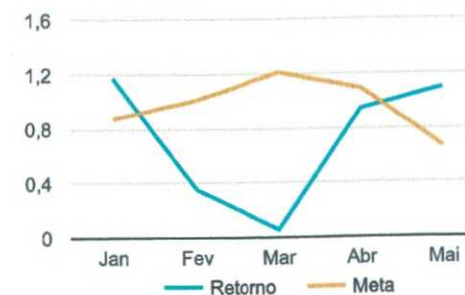
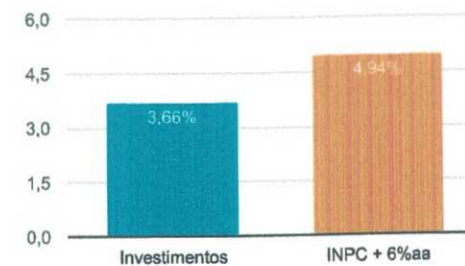
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	5.021.165,73	35,00%
IMA-B 5	3.569.811,38	24,88%
GESTÃO DURATION	2.549.022,84	17,77%
CDI	968.278,36	6,75%
IMA-B	853.124,88	5,95%
IRF-M 1	536.787,27	3,74%
FUNDO IMOBILIÁRIO	407.833,86	2,84%
MULTIMERCADO	324.319,77	2,26%
IRF-M	113.514,52	0,79%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.510,91	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	11.726.438,79	904.169,27	665.241,06	12.105.450,53	140.083,53	1,17%	0,87%	134,29%	1,05%
Fevereiro	12.105.450,53	1.082.388,43	498.426,98	12.733.903,33	44.491,35	0,35%	1,01%	34,85%	0,56%
Março	12.733.903,33	1.370.946,14	891.419,68	13.220.992,84	7.563,05	0,06%	1,21%	4,72%	1,68%
Abril	13.220.992,84	457.569,66	431.659,37	13.371.523,65	124.620,52	0,94%	1,09%	86,33%	1,16%
Mai	13.371.523,65	5.085.966,06	4.268.934,93	14.343.858,61	155.303,83	1,09%	0,66%	165,65%	1,69%
Acumulado no ano					472.062,28	3,66%	4,94%	74,19%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	477.596,55	0,00	0,00	494.998,84	17.402,29	3,64%	2,13%	3,64%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	345.591,81	0,00	0,00	358.126,04	12.534,23	3,63%	2,16%	3,63%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	911.180,19	0,00	0,00	935.939,54	24.759,35	2,72%	1,51%	2,72%	
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	111.486,38	0,00	0,00	113.514,52	2.028,14	1,82%	1,08%	1,82%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	963.873,59	1.000.000,00	0,00	1.985.341,85	21.468,26	1,09%	0,86%	1,37%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	568.421,60	1.000.000,00	0,00	1.584.469,53	16.047,93	1,02%	0,85%	1,37%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.930.471,16	1.000.000,00	0,00	2.956.736,87	26.265,71	0,90%	0,63%	1,06%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.049.266,37	1.000.000,00	0,00	2.064.428,86	15.162,49	0,74%	0,59%	0,95%	
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.603.328,65	0,00	0,00	1.613.083,30	9.754,65	0,61%	-	-	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.289.048,55	48.222,08	2.000.000,00	346.877,95	9.607,32	0,41%	0,10%	0,65%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.180.958,27	0,00	2.000.000,00	189.909,32	8.951,05	0,41%	0,10%	0,65%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	155.268,19	917.743,98	168.222,08	907.452,00	2.661,91	0,25%	0,00%	0,45%	
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	41.433,91	120.000,00	100.712,85	60.826,36	105,30	0,07%	0,00%	0,19%	
Total Renda Fixa						166.748,63	1,24%	0,80%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	322.078,87	0,00	0,00	324.319,77	2.240,90	0,70%	2,62%	0,70%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	421.519,56	0,00	0,00	407.833,86	-13.685,70	-3,25%	27,31%	-3,25%
Total Renda Variável					-11.444,80	-1,54%	16,37%	

