

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

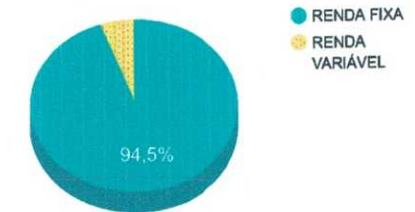
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.611.410,88	10,79%	576	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	326.609,89	2,19%	688	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.087.250,52	13,98%	873	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	190.998,37	1,28%	1.419	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.992.776,94	20,04%	920	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	371.426,46	2,49%	616	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.019.058,17	13,52%	889	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	23.860,62	0,16%	1.250	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	418.501,26	2,80%	130	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	1.128.535,98	7,56%	141	0,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	319.841,49	2,14%	719	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.627.622,61	10,90%	33	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	961.535,63	6,44%	560	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	32.501,24	0,22%	165.425	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	329.140,93	2,20%	4.506	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	489.948,06	3,28%		0,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			14.931.019,05				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.515,47				Artigo 6º
Total			14.932.534,52				

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

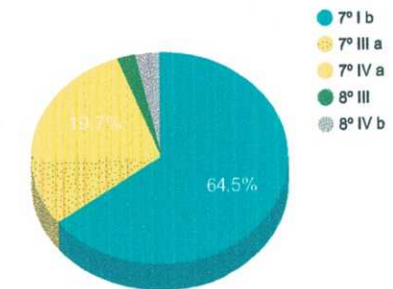
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	9.623.391,85	64,45%	20,00%	30,00%	80,00%	2.321.423,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.547.037,24	10,36%	5,00%	10,00%	60,00%	7.411.574,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	2.941.500,97	19,70%	10,00%	30,00%	40,00%	3.030.906,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	2.986.203,81
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	329.140,93	2,20%	0,00%	10,00%	10,00%	1.163.960,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	489.948,06	3,28%	0,00%	5,00%	5,00%	256.602,89
Total Carteira		14.931.019,05					

RENDA FIXA	14.113.445,53	94,52%
RENDA VARIÁVEL	819.088,99	5,49%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	9.623.391,85	64,45%	20,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.547.037,24	10,36%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.941.500,97	19,70%	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	329.140,93	2,20%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	489.948,06	3,28%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	14.931.019,05	100,00%	35,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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)

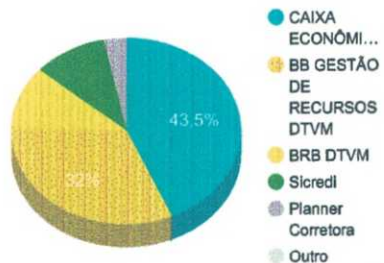
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.493.510,04	43,49%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.772.901,10	31,97%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	1.627.622,61	10,90%	0,23%
SICREDI	1.547.037,24	10,36%	0,00%
ZION Invest	489.948,06	3,28%	0,10%

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

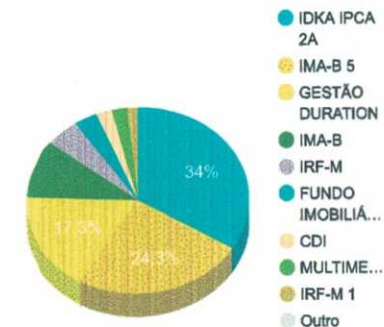
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (junho / 2019) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.493.510,04	43,49%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.772.901,10	31,97%
BRB DTVM	1.627.622,61	10,90%
Sicredi	1.547.037,24	10,36%
Planner Corretora	489.948,06	3,28%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.515,47	0,01%



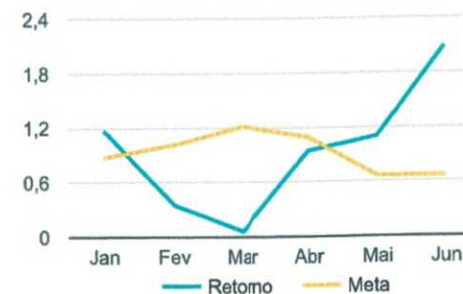
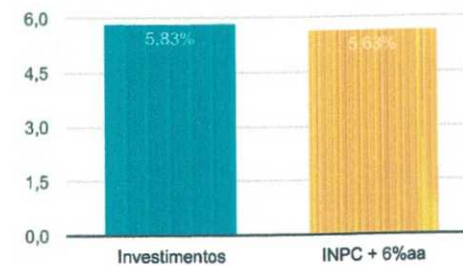
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	5.080.027,46	34,02%
IMA-B 5	3.630.469,05	24,31%
GESTÃO DURATION	2.589.158,24	17,34%
IMA-B	1.499.962,44	10,05%
IRF-M	745.111,15	4,99%
FUNDO IMOBILIÁRIO	489.948,06	3,28%
CDI	352.342,73	2,36%
MULTIMERCADO	329.140,93	2,20%
IRF-M 1	214.858,99	1,44%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.515,47	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%
Junho	14.343.858,61	1.938.886,80	1.657.185,67	14.931.019,05	305.459,31	2,09%	0,66%	316,08%	2,71%
Acumulado no ano					777.521,59	5,83%	5,63%	103,51%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	358.126,04	0,00	0,00	371.426,46	13.300,42	3,71%	2,33%	3,71%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	494.998,84	600.000,00	0,00	1.128.535,98	33.537,14	3,06%	2,30%	3,83%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	935.939,54	0,00	0,00	961.535,63	25.596,09	2,73%	1,65%	2,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.584.469,53	0,00	0,00	1.611.410,88	26.941,35	1,70%	1,35%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.985.341,85	0,00	0,00	2.019.058,17	33.716,32	1,70%	1,34%	1,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.956.736,87	0,00	0,00	2.992.776,94	36.040,07	1,22%	0,95%	1,22%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	113.514,52	300.000,00	0,00	418.501,26	4.986,74	1,21%	1,18%	2,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.064.428,86	0,00	0,00	2.087.250,52	22.821,66	1,11%	0,91%	1,11%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.613.083,30	0,00	0,00	1.627.622,61	14.539,31	0,90%	0,42%	0,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	324.358,29	0,00	326.609,89	2.251,60	0,69%	1,19%	2,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	189.909,32	0,00	0,00	190.998,37	1.089,05	0,57%	0,15%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	346.877,95	0,00	324.358,29	23.860,62	1.340,96	0,39%	0,17%	0,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	907.452,00	310.170,22	900.010,18	319.841,49	2.229,45	0,18%	0,00%	0,39%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	60.826,36	404.358,29	432.817,20	32.501,24	133,79	0,03%	0,00%	0,16%
				Total Renda Fixa	218.523,95	1,57%	1,15%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	407.833,86	0,00	0,00	489.948,06	82.114,20	20,13%	47,87%	20,13%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	324.319,77	0,00	0,00	329.140,93	4.821,16	1,49%	2,39%	1,49%
Total Renda Variável					86.935,36	11,87%	29,60%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.910.073,91	1.000.000,00	0,00	2.992.776,94	82.703,03	3,22%	3,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	953.592,81	1.000.000,00	0,00	2.019.058,17	65.465,36	3,92%	4,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	701.203,10	200.000,00	0,00	961.535,63	60.332,53	6,69%	6,70%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	470.593,81	600.000,00	0,00	1.128.535,98	57.942,17	8,41%	9,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.037.801,34	1.000.000,00	0,00	2.087.250,52	49.449,18	2,98%	3,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	562.319,43	1.000.000,00	0,00	1.611.410,88	49.091,45	3,86%	4,22%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.591.844,74	0,00	0,00	1.627.622,61	35.777,87	2,25%	2,25%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	340.498,28	0,00	0,00	371.426,46	30.928,18	9,08%	9,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.277.698,31	48.222,08	2.324.358,29	23.860,62	22.298,52	1,30%	1,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.170.075,88	0,00	2.000.000,00	190.998,37	20.922,49	1,49%	1,74%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	110.827,85	300.000,00	0,00	418.501,26	7.673,41	3,66%	4,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	326.072,32	1.367.137,89	1.379.258,96	319.841,49	5.890,24	0,65%	1,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	324.358,29	0,00	326.609,89	2.251,60	0,69%	4,54%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	43.565,70	642.704,26	654.162,72	32.501,24	394,00	0,19%	0,54%
				Total Renda Fixa	491.120,03	3,70%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	405.096,72	0,00	0,00	489.948,06	84.851,34	20,95%	20,95%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	319.728,64	0,00	0,00	329.140,93	9.412,29	2,94%	2,94%
				Total Renda Variável	94.263,63	13,01%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.863.409,03	1.000.000,00	0,00	2.992.776,94	129.367,91	5,80%	5,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	927.213,07	1.000.000,00	0,00	2.019.058,17	91.845,10	6,87%	7,17%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.551.267,41	0,00	0,00	1.627.622,61	76.355,20	4,92%	4,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.012.569,18	1.000.000,00	0,00	2.087.250,52	74.681,34	5,54%	5,76%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,00	1.060.000,00	0,00	1.128.535,98	68.535,98	10,90%	14,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	546.867,69	1.000.000,00	0,00	1.611.410,88	64.543,19	6,79%	7,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	900.000,00	0,00	961.535,63	61.535,63	6,88%	10,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.239.988,65	53.182,50	2.324.358,29	23.860,62	55.047,76	2,78%	3,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.138.711,19	0,00	2.000.000,00	190.998,37	52.287,18	2,98%	3,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	322.870,11	0,00	0,00	371.426,46	48.556,35	15,04%	15,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	517.486,06	2.923.252,55	3.133.289,47	319.841,49	12.392,35	1,31%	2,53%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	108.367,29	300.000,00	0,00	418.501,26	10.133,97	6,01%	7,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	324.358,29	0,00	326.609,89	2.251,60	0,69%	6,86%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	26.901,03	960.133,02	955.219,93	32.501,24	687,12	0,40%	1,07%
				Total Renda Fixa	748.220,68	5,97%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retomo (%)	Instituição (%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	470.788,08	0,00	0,00	489.948,06	19.159,98	4,07%	4,07%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	319.000,00	0,00	329.140,93	10.140,93	3,18%	6,33%
				Total Renda Variável	29.300,91	4,43%	

