

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2019

arteira consolidada de investimentos - base (julho / 2019)

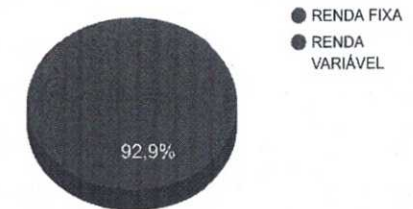
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	972.177,15	6,43%	600	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.626.974,07	10,76%	597	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	330.114,58	2,18%	696	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.107.751,07	13,94%	877	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	192.335,11	1,27%	1.391	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.020.233,30	19,98%	937	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	376.157,37	2,49%	651	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.038.182,54	13,48%	902	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.027,45	0,16%	1.230	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	1.142.056,72	7,55%	205	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	423.326,42	2,80%	160	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	23.685,10	0,16%	165.641	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	127.744,19	0,85%	720	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.637.921,64	10,83%	33	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	639.439,75	4,23%	4.989	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	435.205,26	2,88%		0,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>15.117.331,72</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.515,47				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>15.118.847,19</b>				

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

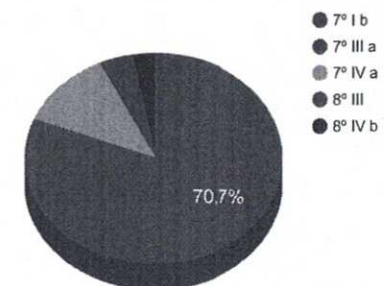
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	10.687.952,64	70,70%	20,00%	30,00%	80,00%	1.405.912,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.565.383,14	10,35%	5,00%	10,00%	60,00%	7.505.015,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	1.789.350,93	11,84%	10,00%	30,00%	40,00%	4.257.581,76
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	3.023.466,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	639.439,75	4,23%	0,00%	10,00%	10,00%	872.293,42
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	435.205,26	2,88%	0,00%	5,00%	5,00%	320.661,33
<b>Total Carteira</b>		<b>15.117.331,72</b>					

RENDA FIXA	14.044.202,18	92,90%
RENDA VARIÁVEL	1.074.645,01	7,11%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	10.687.952,64	70,70%	20,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.565.383,14	10,35%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.789.350,93	11,84%	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	639.439,75	4,23%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	435.205,26	2,88%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>15.117.331,72</b>	<b>100,00%</b>	<b>35,00</b>	<b>240,00</b>

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	6.862.367,85	45,39%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.616.453,83	30,54%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	1.637.921,64	10,83%	0,23%
SICREDI	1.565.383,14	10,35%	0,00%
ZION Invest	435.205,26	2,88%	0,09%

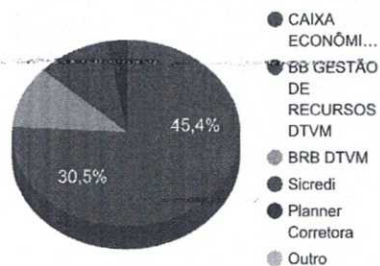
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2019)

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

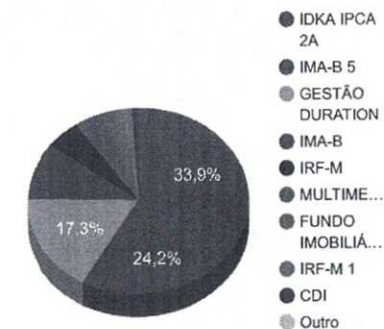


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (julho / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.862.367,85	45,39%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.616.453,83	30,54%
BRB DTVM	1.637.921,64	10,83%
Sicredi	1.565.383,14	10,35%
Planner Corretora	435.205,26	2,88%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.515,47	0,01%



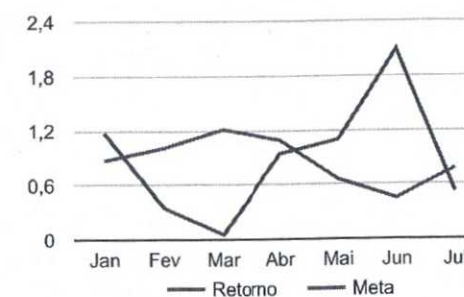
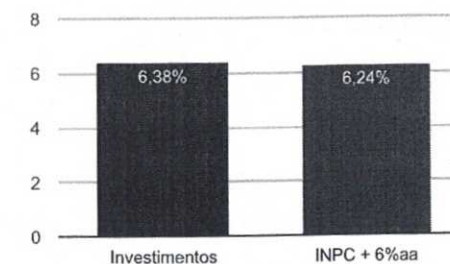
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	5.127.984,37	33,92%
IMA-B 5	3.665.156,61	24,24%
GESTÃO DURATION	2.610.098,79	17,27%
IMA-B	1.518.214,09	10,04%
IRF-M	753.441,00	4,98%
MULTIMERCADO	639.439,75	4,23%
FUNDO IMOBILIÁRIO	435.205,26	2,88%
IRF-M 1	216.362,56	1,43%
CDI	151.429,29	1,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	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%	0,45%	463,77%	2,71%
Julho	14.931.019,05	604.384,16	496.649,89	15.117.331,72	78.578,40	0,52%	0,78%	66,60%	1,53%
Acumulado no ano					856.099,99	6,38%	6,24%	102,31%	

**Acumulado no Ano**





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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	371.426,46	0,00	0,00	376.157,37	4.730,91	1,27%	1,34%	1,27%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.128.535,98	0,00	0,00	1.142.056,72	13.520,74	1,20%	1,34%	1,20%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	418.501,26	0,00	0,00	423.326,42	4.825,16	1,15%	0,69%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	961.535,63	0,00	0,00	972.177,15	10.641,52	1,11%	1,03%	1,11%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	326.609,89	0,00	0,00	330.114,58	3.504,69	1,07%	0,63%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.087.250,52	0,00	0,00	2.107.751,07	20.500,55	0,98%	0,58%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.611.410,88	0,00	0,00	1.626.974,07	15.563,19	0,97%	0,76%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.019.058,17	0,00	0,00	2.038.182,54	19.124,37	0,95%	0,75%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.992.776,94	0,00	0,00	3.020.233,30	27.456,36	0,92%	0,58%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	190.998,37	0,00	0,00	192.335,11	1.336,74	0,70%	0,12%	0,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.860,62	0,00	0,00	24.027,45	166,83	0,70%	0,12%	0,70%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.627.622,61	0,00	0,00	1.637.921,64	10.299,03	0,63%	0,26%	0,63%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	319.841,49	199.384,16	392.701,34	127.744,19	1.219,88	0,23%	0,00%	0,47%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	32.501,24	95.000,00	103.948,55	23.685,10	132,41	0,10%	0,00%	0,20%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>133.022,38</b>	<b>0,94%</b>	<b>0,69%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	329.140,93	310.000,00	0,00	639.439,75	298,82	0,05%	1,92%	0,62%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	489.948,06	0,00	0,00	435.205,26	-54.742,80	-11,17%	28,03%	-11,17%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-54.443,98</b>	<b>-4,82%</b>	<b>12,50%</b>	

