

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

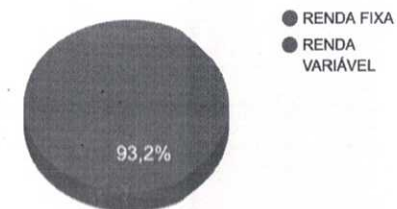
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.627.529,65	10,43%	605	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	193.344,81	1,24%	1.390	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	374.595,04	2,40%	671	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.023.254,44	19,38%	940	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.038.894,17	13,07%	915	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.151,66	0,15%	1.214	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	330.899,93	2,12%	700	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.108.853,14	13,52%	875	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	970.918,14	6,22%	630	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	1.137.891,84	7,29%	277	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	423.805,80	2,72%	209	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	17.684,50	0,11%	166.227	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	618.274,77	3,96%	733	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.638.981,57	10,51%	33	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	641.323,42	4,11%	5.330	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	426.993,84	2,74%		0,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			15.597.396,72				
DISPONIBILIDADE FINANCEIRAS			1.512,50				Artigo 6º
Total			15.598.909,22				

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

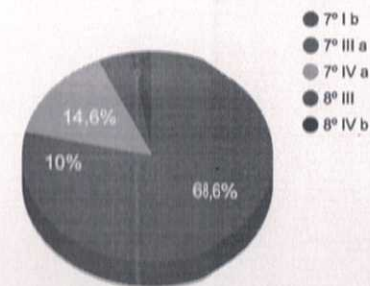
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	10.692.440,98	68,55%	20,00%	30,00%	80,00%	1.785.476,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.561.697,64	10,01%	5,00%	10,00%	60,00%	7.796.740,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	2.274.940,84	14,59%	10,00%	30,00%	40,00%	3.964.017,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	20,00%	3.119.479,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	641.323,42	4,11%	0,00%	10,00%	10,00%	918.416,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	426.993,84	2,74%	0,00%	5,00%	5,00%	352.876,00
Total Carteira		15.597.396,72					

RENDA FIXA	14.530.591,96	93,16%
RENDA VARIÁVEL	1.068.317,26	6,85%

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 " b "	10.692.440,98	68,55%	20,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.561.697,64	10,01%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.274.940,84	14,58%	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	641.323,42	4,11%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	426.993,84	2,74%	0,00%	5,00%
Total	15.597.396,72	99,99%	35,00	240,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.867.734,98	44,03%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.101.988,69	32,71%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	1.638.981,57	10,51%	0,23%
SICREDI	1.561.697,64	10,01%	0,00%
ZION Invest	426.993,84	2,74%	0,09%

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
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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	3,43%	1,26%	2,55%	5,15%	11,14%	1,00%	0,005%	0,10%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,15%	1,42%	0,52%	1,06%	2,14%	4,88%	4,00%	0,003%	0,05%
IRF-M	0,26%	8,42%	3,54%	6,63%	16,67%	23,59%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	8,26%	3,48%	6,51%	16,43%	23,07%	0,20%	1,047%	3,22%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,11%	8,38%	3,47%	6,58%	16,76%	23,48%	0,20%	1,194%	3,46%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	8,22%	2,70%	6,03%	14,23%	21,57%	0,20%	1,039%	2,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	8,23%	2,72%	6,06%	14,19%	21,56%	0,20%	1,022%	2,79%

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

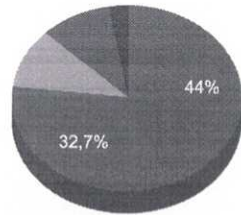
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	-0,77%	22,00%	5,82%	13,81%	38,20%	41,83%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,06%	5,65%	1,61%	3,47%	11,56%	19,76%	0,50%	0,850%	3,64%
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36%	15,93%	4,69%	10,68%	27,29%	32,91%	0,20%	2,477%	7,59%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,42%	16,02%	4,60%	10,63%	27,17%	32,66%	0,20%	2,459%	7,66%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,29%	7,31%	2,42%	4,13%	13,09%	20,78%	1,00%	3,409%	4,14%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,89%	-9,30%	4,70%	-8,24%	-17,46%	-13,33%	1,60%	32,536%	28,97%

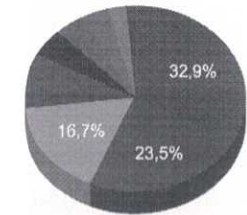
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (agosto / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.867.734,98	44,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.101.988,69	32,71%
BRB DTVM	1.638.981,57	10,51%
Sicredi	1.561.697,64	10,01%
Planner Corretora	426.993,84	2,74%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.512,50	0,01%



- CAIXA ECONÔMI...
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BRB DTVM
- Sicredi
- Planner Corretora
- Outro

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	5.132.107,58	32,90%
IMA-B 5	3.666.423,82	23,50%
GESTÃO DURATION	2.609.899,71	16,73%
IMA-B	1.512.486,88	9,70%
IRF-M	754.705,73	4,84%
MULTIMERCADO	641.323,42	4,11%
CDI	635.959,27	4,08%
FUNDO IMOBILIÁRIO	426.993,84	2,74%
IRF-M 1	217.496,47	1,39%
DISP. FINANCEIRA	1.512,50	0,01%

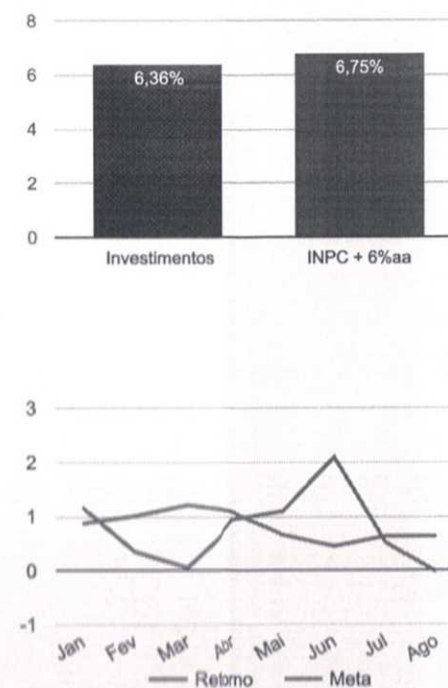


- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- GESTÃO DURATION
- IMA-B
- IRF-M
- MULTIME...
- CDI
- FUNDO IMOBILIÁ...
- IRF-M 1
- Outro

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%	0,63%	82,44%	1,53%
Agosto	15.117.331,72	699.220,18	216.068,78	15.597.396,72	-3.086,40	-0,02%	0,63%	-3,14%	2,01%
Acumulado no ano					853.013,59	6,36%	6,75%	94,27%	

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	192.335,11	0,00	0,00	193.344,81	1.009,70	0,52%	0,18%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.027,45	0,00	0,00	24.151,66	124,21	0,52%	0,18%	0,52%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	330.114,58	0,00	0,00	330.899,93	785,35	0,24%	1,05%	0,24%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	127.744,19	594.220,18	105.000,00	618.274,77	1.310,40	0,18%	0,00%	0,41%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	423.326,42	0,00	0,00	423.805,80	479,38	0,11%	1,19%	0,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.020.233,30	0,00	0,00	3.023.254,44	3.021,14	0,10%	0,74%	0,10%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.637.921,64	0,00	0,00	1.638.981,57	1.059,93	0,06%	0,85%	0,06%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	23.685,10	105.000,00	111.068,78	17.684,50	68,18	0,05%	0,00%	0,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.107.751,07	0,00	0,00	2.108.853,14	1.102,07	0,05%	0,71%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.038.182,54	0,00	0,00	2.038.894,17	711,63	0,03%	1,04%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.626.974,07	0,00	0,00	1.627.529,65	555,58	0,03%	1,02%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	972.177,15	0,00	0,00	970.918,14	-1.259,01	-0,13%	1,74%	-0,13%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.142.056,72	0,00	0,00	1.137.891,84	-4.164,88	-0,36%	2,48%	-0,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	376.157,37	0,00	0,00	374.595,04	-1.562,33	-0,42%	2,46%	-0,42%
				Total Renda Fixa	3.241,35	0,02%	1,05%	

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(%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	639.439,75	0,00	0,00	641.323,42	1.883,67	0,29%	3,41%	0,29%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	435.205,26	0,00	0,00	426.993,84	-8.211,42	-1,89%	32,54%	-1,89%
Total Renda Variável					-6.327,75	-0,59%	15,05%	