

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2019)

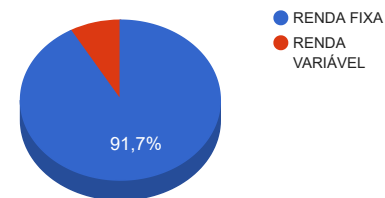
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.875.905,86	1,73%	600	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	201.329,92	0,12%	651	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	155.054,58	0,09%	333	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	113.959,31	0,07%	696	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.914.590,93	4,16%	937	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.008.865,85	4,22%	1.230	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	35.036,62	0,02%	277	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	77.581.040,16	46,72%	1.391	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	25.403.020,25	15,30%	11	22,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	26.078.796,68	15,70%	784	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.897.177,47	3,55%	96	1,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	50.120,15	0,03%	15.866	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	4.284.480,49	2,58%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
AQ3 RENDA FII - ARF111B	Não se aplica	Não se aplica	4.205.767,71	2,53%		3,33%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1801	90 dias	5.250.009,77	3,16%	10	5,24%	Desenquadrado - RV
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>166.055.155,75</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			7.545,99				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>166.062.701,74</b>				

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

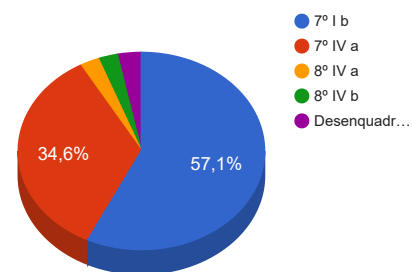
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	94.885.783,23	57,14%	15,00%	25,00%	70,00%	21.352.825,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	99.633.093,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	57.429.114,55	34,58%	10,00%	30,00%	40,00%	8.992.947,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	8.302.757,79
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	33.211.031,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	16.605.515,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.284.480,49	2,58%	2,00%	5,00%	5,00%	4.018.277,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.205.767,71	2,53%	2,00%	5,00%	5,00%	4.096.990,08
Desenquadrado - RV	0,00%	5.250.009,77	3,16%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.250.009,77
<b>Total Carteira</b>		<b>166.055.155,75</b>					

RENDA FIXA	152.322.443,77	91,73%
RENDA VARIÁVEL	13.740.257,97	8,27%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	94.885.783,23	57,14%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	57.429.114,55	34,58%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	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 II, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.284.480,49	2,58%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.205.767,71	2,53%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	5.250.009,77	3,16%	0,00%	0,00%
Total	166.055.155,75	100,00%	50,00	240,00

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	119.432.667,87	71,92%	0,02%
ROMA ASSET	34.937.510,51	21,04%	28,62%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.479.209,66	4,50%	0,00%
Reditus Investimentos	4.205.767,71	2,53%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,51%	22,95%	12,19%	15,32%	38,55%	44,87%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,49%	22,60%	12,07%	15,03%	37,98%	43,91%	0,20%	1,883%	11,76%
IMA-B	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	16,50%	8,84%	11,64%	27,11%	34,97%	0,20%	1,342%	7,68%
IRF-M 1+	1,27%	9,72%	6,27%	7,88%	18,56%	28,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	9,50%	6,23%	7,71%	18,26%	27,73%	0,20%	0,942%	5,53%
IRF-M	1,09%	8,14%	5,09%	6,66%	15,28%	24,57%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	8,01%	5,04%	6,55%	15,04%	24,05%	0,20%	0,631%	3,81%
IDKA IPCA 2 Anos	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	6,95%	3,23%	5,61%	11,87%	21,28%	0,20%	0,578%	1,92%
IMA-B 5	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,60%	-19,10%	-18,35%	-18,49%	-13,82%	-0,39%	1,30%	9,441%	19,10%
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	3,95%	1,94%	3,37%	7,11%	14,84%	0,20%	0,124%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	3,65%	1,63%	3,10%	6,27%	13,52%	0,20%	0,014%	0,14%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	3,58%	1,55%	3,03%	6,19%	13,55%	0,20%	0,004%	0,13%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,11%	0,69%	0,30%	0,58%	1,18%	3,11%	5,00%	0,000%	0,02%
IPCA	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	12,15%	6,69%	9,01%	16,92%	25,04%	0,002	1,027%	3,40%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

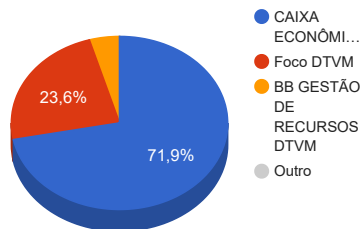
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	1,50%	0,000%	0,00%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,59%	-10,78%	-7,70%	-7,78%	-10,06%	8,01%	0,45%	1,617%	8,04%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

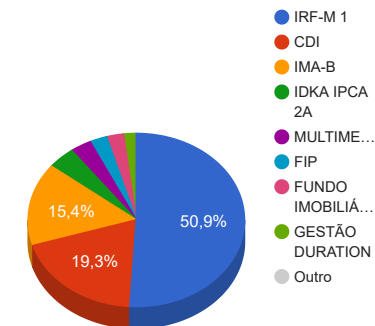


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (julho / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	119.432.667,87	71,92%
Foco DTVM	39.143.278,22	23,57%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.479.209,66	4,50%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	7.545,99	0,00%



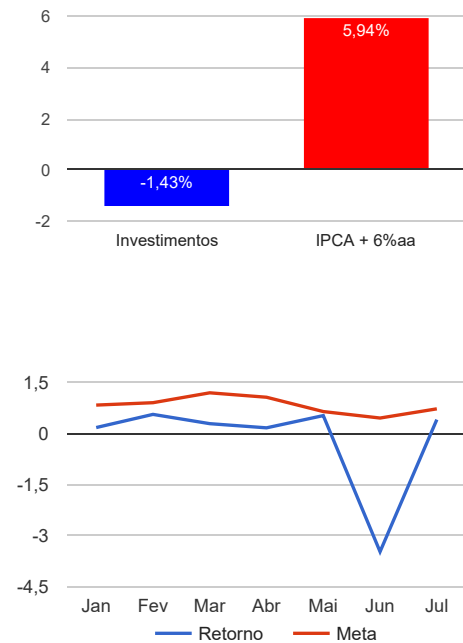
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	84.589.906,01	50,94%
CDI	32.026.094,30	19,29%
IMA-B	25.604.350,17	15,42%
IDKA IPCA 2A	6.914.590,93	4,16%
MULTIMERCADO	5.250.009,77	3,16%
FIP	4.284.480,49	2,58%
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.205.767,71	2,53%
GESTÃO DURATION	2.875.905,86	1,73%
IMA-B 5+	155.054,58	0,09%
IRF-M	113.959,31	0,07%
IRF-M 1+	35.036,62	0,02%
DISP. FINANCEIRA	7.545,99	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	163.157.262,13	0,00	683.400,00	162.752.567,82	278.705,69	0,17%	0,83%	20,54%	0,43%
Fevereiro	162.752.567,82	1.087.050,00	105.000,00	164.646.943,89	912.326,07	0,56%	0,90%	62,22%	0,56%
Março	164.646.943,89	854.175,56	152.000,00	165.820.330,11	471.210,66	0,28%	1,19%	23,88%	1,02%
Abril	165.820.330,11	858.083,74	114.000,00	166.834.863,67	270.449,82	0,16%	1,06%	15,32%	1,17%
Mai	166.834.863,67	1.030.378,80	250.000,00	168.489.449,88	874.207,41	0,52%	0,64%	81,41%	1,69%
Junho	168.489.449,88	3.661.049,75	1.569.980,19	164.659.819,61	-5.920.699,83	-3,47%	0,45%	-770,73%	4,47%
Julho	164.659.819,61	1.535.378,80	808.500,00	166.055.155,75	668.457,34	0,40%	0,72%	55,81%	1,65%
Acumulado no ano					-2.445.342,84	-1,43%	5,94%	-24,00%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	152.775,75	0,00	0,00	155.054,58	2.278,83	1,49%	1,88%	1,49%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.593,72	0,00	0,00	35.036,62	442,90	1,28%	0,94%	1,28%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	198.797,81	0,00	0,00	201.329,92	2.532,11	1,27%	1,34%	1,27%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	112.749,45	0,00	0,00	113.959,31	1.209,86	1,07%	0,63%	1,07%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.851.731,75	0,00	0,00	6.914.590,93	62.859,18	0,92%	0,58%	0,92%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.340.333,38	1.515.378,80	0,00	2.875.905,86	20.193,68	0,71%	1,03%	1,11%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.960.200,60	0,00	0,00	7.008.865,85	48.665,25	0,70%	0,12%	0,70%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	77.846.030,25	0,00	808.500,00	77.581.040,16	543.509,91	0,70%	0,12%	0,70%	
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.864.319,72	0,00	0,00	5.897.177,47	32.857,75	0,56%	0,01%	0,56%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.936.048,08	0,00	0,00	26.078.796,68	142.748,60	0,55%	0,00%	0,55%	
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	30.087,58	20.000,00	0,00	50.120,15	32,57	0,07%	0,00%	0,11%	
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	25.555.525,40	0,00	0,00	25.403.020,25	-152.505,15	-0,60%	9,44%	-0,60%	
Total Renda Fixa						704.825,49	0,46%	1,69%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.285.711,90	0,00	0,00	4.284.480,49	-1.231,41	-0,03%	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.209.892,44	0,00	0,00	4.205.767,71	-4.124,73	-0,10%	0,00%	0,00%
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.281.021,78	0,00	0,00	5.250.009,77	-31.012,01	-0,59%	1,62%	-0,59%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-36.368,15</b>	<b>-0,26%</b>	<b>0,90%</b>	