

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.911.831,93	10,13%	417	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	795.008,48	0,90%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.094.830,06	2,38%	1.390	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.135.883,26	8,11%	940	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.139.944,33	1,30%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.684.061,63	8,74%	915	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.370.766,00	1,56%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	101.728,66	0,12%	1.214	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	79.074,22	0,09%	875	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	776.749,74	0,88%	671	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.243.914,56	2,55%	962	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.251.779,69	1,42%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.502.375,66	1,71%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	16.518.632,34	18,78%	630	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	D+1	Não há	340.660,71	0,39%	142	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.159.652,86	1,32%	300	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.147.825,04	1,31%	770	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.889.558,34	5,56%	271	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.227.429,90	2,53%	56	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.478.510,14	1,68%	353	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	937.312,29	1,07%	701	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.162.171,75	1,32%	74	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

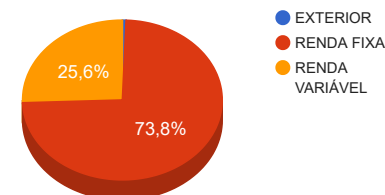
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.086.500,96	1,24%	6	1,70%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.442.367,68	1,64%	95	0,34%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRASESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.768.066,43	3,15%	2.606	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.542.772,78	4,03%	2.171	2,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	753.269,65	0,86%	169	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	Não há	1.030.986,63	1,17%	69	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.161.255,31	3,59%	5.196	1,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.558.750,99	1,77%	151	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	566.688,57	0,64%	46.226	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.232.933,89	2,54%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.128.386,64	1,28%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.961.738,14	3,37%	219	0,54%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	242.673,49	0,28%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	522.761,87	0,59%	66	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total			87.948.854,62				

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

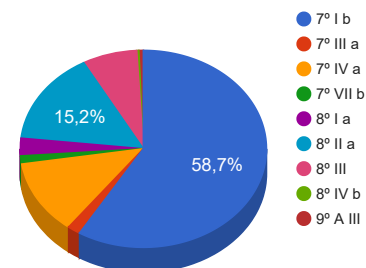
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	51.606.580,56	58,68%	15,00%	27,00%	90,00%	27.547.388,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.500.313,57	1,71%	0,00%	10,00%	60,00%	51.268.999,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	10.680.635,71	12,14%	10,00%	30,00%	40,00%	24.498.906,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.397.442,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.162.171,75	1,32%	0,00%	2,00%	5,00%	3.235.270,98
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.528.868,64	2,88%	0,00%	5,00%	10,00%	6.266.016,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	13.381.790,36	15,22%	0,00%	10,00%	20,00%	4.207.980,56
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.323.058,67	7,19%	0,00%	10,00%	10,00%	2.471.826,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	4.397.442,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	242.673,49	0,28%	0,00%	2,00%	5,00%	4.154.769,24
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	879.488,55
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	522.761,87	0,59%	0,00%	1,00%	5,00%	3.874.680,86
Total Carteira		87.948.854,62					

EXTERIOR	522.761,87	0,59%
RENDA FIXA	64.949.701,59	73,85%
RENDA VARIÁVEL	22.476.391,16	25,56%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	51.606.580,56	58,68%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.500.313,57	1,71%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	10.680.635,71	12,14%	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%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.162.171,75	1,32%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.528.868,64	2,88%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	13.381.790,36	15,22%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.323.058,67	7,19%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	242.673,49	0,28%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 9º - A, Inciso III	522.761,87	0,59%	0,00%	5,00%
Total	87.948.854,62	100,00%	25,00	291,00

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	64.917.029,77	73,81%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.069.428,59	10,31%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	8.101.498,86	9,21%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	4.246.576,57	4,83%	0,00%
VINCI PARTNERS	1.030.986,63	1,17%	0,00%
SICREDI	340.660,71	0,39%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	242.673,49	0,28%	0,02%

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
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,60%	1,81%	4,78%	9,56%	20,95%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	8,83%	2,72%	6,37%	15,98%	31,78%	0,20%	0,999%	3,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	9,43%	2,91%	6,82%	17,11%	23,69%	0,15%	1,116%	3,71%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,11%	0,83%	-0,99%	2,21%	3,49%	8,07%	0,20%	4,429%	4,04%
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%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,49%	4,65%	1,84%	3,57%	7,40%	14,65%	0,20%	0,254%	0,49%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,50%	4,18%	1,53%	3,11%	6,24%	13,35%	0,20%	0,022%	0,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,08%	1,51%	3,03%	6,16%	13,44%	0,20%	0,008%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,49%	4,09%	1,50%	3,04%	6,12%	13,21%	0,20%	0,005%	0,12%
Selic	0,50%	4,18%	1,54%	3,11%	6,28%	13,55%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	4,14%	1,54%	3,09%	6,21%	13,42%	0,20%	0,003%	0,11%
IRF-M	0,26%	8,42%	3,54%	6,63%	16,67%	23,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	8,15%	3,46%	6,42%	16,48%	23,01%	0,20%	1,066%	3,46%
IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	9,73%	3,85%	6,83%	13,26%	21,71%	0,40%	0,534%	2,80%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,12%	7,75%	2,27%	5,56%	13,45%	23,04%	0,20%	0,950%	2,42%
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%
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,42%	16,06%	4,57%	10,60%	27,30%	32,79%	0,20%	2,483%	7,74%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,43%	15,90%	4,54%	10,50%	27,09%	32,83%	0,20%	2,487%	7,59%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,42%	-0,17%	-1,10%	0,97%	3,84%	6,03%	0,20%	4,181%	4,44%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,69%	6,30%	1,16%	5,76%	14,70%	14,00%	0,20%	4,432%	8,01%

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
ICON	4,48%	38,69%	18,86%	29,04%	51,42%	35,01%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	4,38%	38,01%	19,14%	28,89%	48,79%	30,12%	1,60%	11,750%	17,02%
IDIV	2,23%	24,66%	8,32%	13,12%	50,25%	50,69%	-	-	-
BRABESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,48%	10,55%	2,22%	2,82%	30,27%	42,06%	1,50%	11,441%	12,97%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,14%	1,63%	3,68%	8,27%	15,85%	0,60%	1,866%	0,74%
SMLL	0,48%	27,92%	14,76%	19,08%	51,06%	47,54%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1,62%	25,58%	11,49%	13,42%	52,97%	56,48%	1,72%	12,077%	16,54%
IGCT	0,44%	16,91%	5,64%	7,65%	37,71%	44,80%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	0,37%	16,40%	5,44%	7,26%	36,90%	43,54%	0,90%	11,526%	14,75%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1,66%	33,07%	13,19%	17,45%	66,45%	56,32%	2,00%	11,813%	20,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,58%	22,68%	11,81%	15,00%	47,57%	64,39%	2,50%	11,807%	15,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,57%	24,51%	12,99%	14,33%	46,36%	62,65%	1,90%	11,003%	14,23%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,40%	3,56%	1,42%	2,70%	7,96%	-	1,60%	0,106%	1,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,36%	5,45%	2,13%	4,21%	11,87%	-	1,60%	0,487%	2,66%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-0,69%	14,68%	4,07%	5,60%	31,15%	41,26%	0,50%	11,532%	14,32%

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

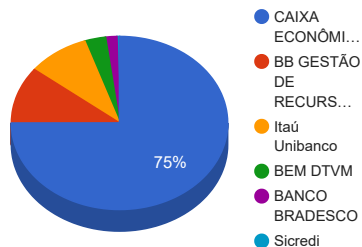
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,90%	22,13%	3,09%	9,40%	52,10%	-	2,00%	11,657%	23,65%
IFIX	-0,11%	12,97%	4,07%	9,12%	24,18%	27,48%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (agosto / 2019)

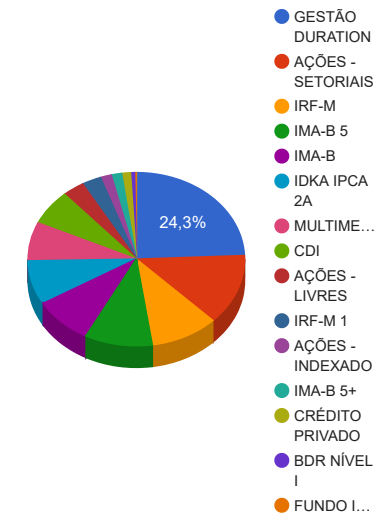
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	6,06%	24,78%	11,52%	16,91%	2,97%	60,77%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	6,02%	24,10%	11,56%	16,53%	2,30%	56,43%	0,70%	9,287%	22,94%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	65.948.016,40	74,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.312.102,08	10,59%
Itaú Unibanco	8.101.498,86	9,21%
BEM DTVM	2.768.066,43	3,15%
BANCO BRADESCO	1.478.510,14	1,68%
Sicredi	340.660,71	0,39%

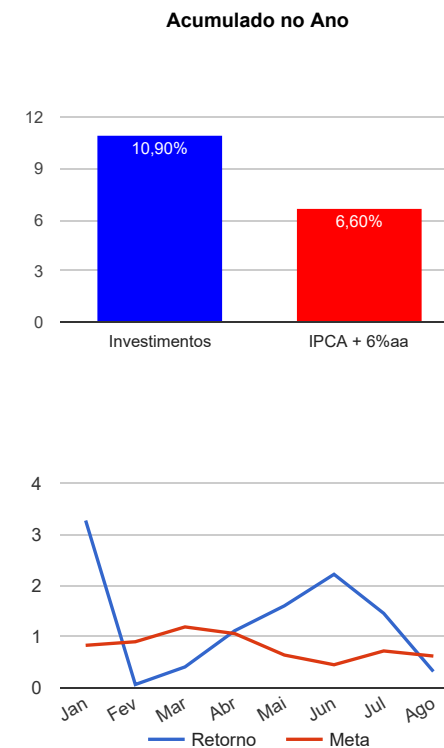


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	21.408.190,68	24,34%
AÇÕES - SETORIAIS	11.589.582,11	13,18%
IRF-M	8.911.831,93	10,13%
IMA-B 5	8.824.005,96	10,03%
IMA-B	7.729.480,99	8,79%
IDKA IPCA 2A	7.214.957,48	8,20%
MULTIMERCADO	6.323.058,67	7,19%
CDI	5.791.077,37	6,58%
AÇÕES - LIVRES	2.878.709,21	3,27%
IRF-M 1	2.537.219,43	2,88%
AÇÕES - INDEXADO	1.442.367,68	1,64%
IMA-B 5+	1.370.766,00	1,56%
CRÉDITO PRIVADO	1.162.171,75	1,32%
BDR NÍVEL I	522.761,87	0,59%
FUNDO IMOBILIÁRIO	242.673,49	0,28%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	80.445.558,00	1.132.453,93	2.697.847,21	81.511.600,07	2.631.435,35	3,27%	0,83%	393,34%	2,09%
Fevereiro	81.511.600,07	7.523.087,89	6.241.455,76	82.845.672,69	52.440,49	0,06%	0,90%	7,07%	2,57%
Março	82.845.672,69	1.690.098,38	2.423.381,46	82.449.984,44	337.594,83	0,41%	1,19%	34,14%	3,51%
Abril	82.449.984,44	3.101.558,79	2.930.697,93	83.541.954,06	921.108,76	1,11%	1,06%	105,22%	1,99%
Mai	83.541.954,06	6.457.581,22	6.220.787,61	85.121.083,24	1.342.335,57	1,60%	0,64%	250,09%	2,28%
Junho	85.121.083,24	3.192.211,70	3.012.029,79	87.194.189,63	1.892.924,48	2,22%	0,45%	492,76%	2,12%
Julho	87.194.189,63	3.657.107,79	4.747.191,23	87.373.372,00	1.269.265,81	1,46%	0,72%	200,99%	1,70%
Agosto	87.373.372,00	5.164.990,88	4.869.069,46	87.948.854,62	279.561,20	0,32%	0,62%	51,39%	3,21%
Acumulado no ano					8.726.666,49	10,90%	6,60%	165,22%	



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 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.400.267,00	0,00	38.733,70	1.370.766,00	9.232,70	0,66%	4,43%	-2,11%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	101.205,49	0,00	0,00	101.728,66	523,17	0,52%	0,18%	0,52%	
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.216.297,33	0,00	0,00	2.227.429,90	11.132,57	0,50%	0,02%	0,50%	
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.471.192,93	0,00	0,00	1.478.510,14	7.317,21	0,50%	0,00%	0,50%	
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	324.260,56	14.787,74	0,00	340.660,71	1.612,41	0,48%	0,25%	0,49%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	870.963,58	61.919,68	0,00	937.312,29	4.429,03	0,47%	0,01%	0,49%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.037.559,53	104.971,13	0,00	1.147.825,04	5.294,38	0,46%	0,01%	0,49%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.924.771,65	2.809.981,95	2.652.714,02	2.094.830,06	12.790,48	0,27%	0,18%	0,52%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.168.208,64	0,00	31.000,19	1.139.944,33	2.735,88	0,23%	4,18%	-2,42%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.379.176,93	1.500.000,00	0,00	4.889.558,34	10.381,41	0,21%	0,53%	0,32%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.894.336,27	0,00	0,00	8.911.831,93	17.495,66	0,20%	1,07%	0,20%	
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.160.743,18	0,00	0,00	1.162.171,75	1.428,57	0,12%	0,95%	0,12%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.005.794,41	123.330,38	0,00	7.135.883,26	6.758,47	0,09%	0,74%	0,10%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.540.026,57	0,00	38.874,24	1.502.375,66	1.223,33	0,08%	1,00%	0,08%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	815.144,08	0,00	20.620,07	795.008,48	484,47	0,06%	1,12%	0,06%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	79.032,90	0,00	0,00	79.074,22	41,32	0,05%	0,71%	0,05%	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.286.422,26	0,00	35.237,24	1.251.779,69	594,67	0,05%	4,43%	-2,69%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.681.379,62	0,00	0,00	7.684.061,63	2.682,01	0,03%	1,04%	0,03%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	18.034.116,67	0,00	1.500.000,00	16.518.632,34	-15.484,33	-0,09%	1,74%	-0,13%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	779.989,35	0,00	0,00	776.749,74	-3.239,61	-0,42%	2,46%	-0,42%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.253.446,72	0,00	0,00	2.243.914,56	-9.532,16	-0,42%	2,48%	-0,42%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.164.626,61	0,00	0,00	1.159.652,86	-4.973,75	-0,43%	2,49%	-0,43%	
Total Renda Fixa						62.927,89	0,10%	1,31%	

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 CONSUMO FI AÇÕES	3.028.537,85	0,00	0,00	3.161.255,31	132.717,46	4,38%	11,75%	4,38%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	550.000,00	0,00	566.688,57	16.688,57	3,03%	11,00%	1,57%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.485.090,95	0,00	0,00	3.542.772,78	57.681,83	1,66%	11,81%	1,66%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1.014.544,13	0,00	0,00	1.030.986,63	16.442,50	1,62%	12,08%	1,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.534.538,38	0,00	0,00	1.558.750,99	24.212,61	1,58%	11,81%	1,58%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.946.219,46	0,00	0,00	2.961.738,14	15.518,68	0,53%	1,87%	0,53%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.224.077,47	0,00	0,00	2.232.933,89	8.856,42	0,40%	0,11%	0,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.124.360,16	0,00	0,00	1.128.386,64	4.026,48	0,36%	0,49%	0,36%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.632.047,01	0,00	550.000,00	1.086.500,96	4.453,95	0,27%	11,53%	0,37%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.452.449,13	0,00	0,00	1.442.367,68	-10.081,45	-0,69%	11,53%	-0,69%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	760.110,11	0,00	0,00	753.269,65	-6.840,46	-0,90%	11,66%	-0,90%
BRANDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.809.775,47	0,00	0,00	2.768.066,43	-41.709,04	-1,48%	11,44%	-1,48%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	279.595,44	0,00	1.890,00	242.673,49	-35.031,95	-12,53%	-	0,00%
Total Renda Variável					186.935,60	0,84%	8,64%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	493.064,16	0,00	0,00	522.761,87	29.697,71	6,02%	9,29%	6,02%
				Total Exterior	29.697,71	6,02%	9,29%	