

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	18.034.116,67	20,64%	600	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.540.026,57	1,76%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.005.794,41	8,02%	937	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.400.267,00	1,60%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.168.208,64	1,34%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.681.379,62	8,79%	902	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	101.205,49	0,12%	1.230	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	79.032,90	0,09%	877	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	779.989,35	0,89%	651	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	815.144,08	0,93%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.253.446,72	2,58%	956	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.286.422,26	1,47%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.894.336,27	10,18%	408	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.924.771,65	2,20%	1.391	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	D+1	Não há	324.260,56	0,37%	121	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.164.626,61	1,33%	298	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.216.297,33	2,54%	56	0,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	870.963,58	1,00%	724	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.379.176,93	3,87%	258	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.037.559,53	1,19%	784	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.471.192,93	1,68%	357	0,02%	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	1.160.743,18	1,33%	74	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2019)

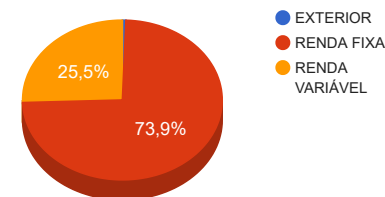
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.452.449,13	1,66%	93	0,36%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.632.047,01	1,87%	6	2,51%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.028.537,85	3,47%	4.208	2,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.809.775,47	3,22%	2.611	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.485.090,95	3,99%	1.622	2,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	760.110,11	0,87%	148	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	Não há	1.014.544,13	1,16%	68	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.534.538,38	1,76%	150	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.224.077,47	2,55%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.946.219,46	3,37%	227	0,52%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.124.360,16	1,29%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	279.595,44	0,32%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	493.064,16	0,56%	68	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total			87.373.372,00				

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

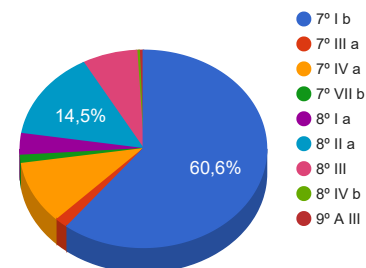
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	52.964.141,63	60,62%	15,00%	27,00%	90,00%	25.671.893,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.488.887,17	1,70%	0,00%	10,00%	60,00%	50.935.136,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.975.190,30	10,27%	10,00%	30,00%	40,00%	25.974.158,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.368.668,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.160.743,18	1,33%	0,00%	2,00%	5,00%	3.207.925,42
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	3.084.496,14	3,53%	0,00%	5,00%	10,00%	5.652.841,06
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	12.632.596,89	14,46%	0,00%	10,00%	20,00%	4.842.077,51
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.294.657,09	7,20%	0,00%	10,00%	10,00%	2.442.680,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	4.368.668,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	279.595,44	0,32%	0,00%	2,00%	5,00%	4.089.073,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	873.733,72
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	493.064,16	0,56%	0,00%	1,00%	5,00%	3.875.604,44
Total Carteira		87.373.372,00					

EXTERIOR	493.064,16	0,56%
RENDA FIXA	64.588.962,28	73,92%
RENDA VARIÁVEL	22.291.345,56	25,51%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	52.964.141,63	60,62%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.488.887,17	1,70%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	8.975.190,30	10,27%	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 "	1.160.743,18	1,33%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	3.084.496,14	3,53%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	12.632.596,89	14,46%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.294.657,09	7,20%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	279.595,44	0,32%	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	493.064,16	0,56%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	87.373.372,00	100,00%	25,00	291,00

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	65.874.806,43	75,39%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.053.434,72	10,36%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	6.545.762,32	7,49%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	4.280.968,40	4,90%	0,00%
VINCI PARTNERS	1.014.544,13	1,16%	0,00%
SICREDI	324.260,56	0,37%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	279.595,44	0,32%	0,02%

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	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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	16,55%	8,83%	11,64%	27,24%	35,12%	0,20%	1,344%	7,75%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,26%	16,40%	8,74%	11,58%	27,06%	35,21%	0,20%	1,334%	7,60%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	9,24%	6,44%	6,66%	14,03%	16,07%	0,20%	1,222%	8,33%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,74%	2,30%	1,91%	1,24%	3,66%	6,90%	0,20%	0,383%	4,56%

IRF-M	1,09%	8,14%	5,09%	6,66%	15,28%	24,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	7,94%	5,04%	6,50%	14,99%	24,00%	0,20%	0,638%	4,08%

IDKA IPCA 2 Anos	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,80%	3,06%	5,52%	11,69%	21,08%	0,20%	0,584%	1,96%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,18%	4,07%	6,55%	13,88%	23,03%	0,20%	0,752%	2,96%

IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,94%	1,83%	5,07%	9,36%	21,07%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	9,37%	4,60%	7,29%	16,26%	25,59%	0,15%	0,875%	4,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	8,75%	4,22%	6,81%	15,25%	32,93%	0,20%	0,792%	3,64%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69%	3,00%	2,07%	2,14%	3,37%	8,26%	0,20%	0,059%	4,12%

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
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,73%	4,14%	2,08%	3,52%	7,31%	15,10%	0,20%	0,155%	0,51%
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 BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,56%	3,66%	1,59%	3,10%	6,29%	13,68%	0,20%	0,009%	0,13%
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	3,57%	1,54%	3,03%	6,22%	13,77%	0,20%	0,003%	0,12%
Selic	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,89%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,56%	3,62%	1,58%	3,07%	6,27%	13,98%	0,20%	0,003%	0,12%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	9,39%	5,38%	6,85%	13,32%	22,76%	0,40%	0,570%	2,79%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,83%	7,62%	3,41%	6,07%	12,90%	24,58%	0,20%	0,568%	2,66%

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
ICON	9,38%	32,74%	14,88%	18,20%	37,70%	40,90%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	9,80%	32,22%	15,54%	17,47%	34,55%	35,84%	1,60%	7,359%	19,23%
SMLL	6,75%	27,31%	16,46%	16,36%	43,96%	59,44%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3,14%	23,58%	12,25%	9,05%	44,86%	67,11%	1,72%	6,018%	18,08%
IDIV	2,76%	21,95%	9,29%	8,41%	41,54%	57,67%	-	-	-
BRABESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,05%	12,22%	4,47%	3,58%	28,57%	52,61%	1,50%	5,707%	13,43%
IFIX	1,27%	13,10%	6,02%	10,37%	23,45%	28,72%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
Ibovespa	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,84%	30,91%	15,79%	14,61%	56,48%	61,92%	2,00%	5,732%	22,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,95%	20,77%	12,77%	11,53%	39,89%	74,37%	2,50%	6,181%	16,97%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,10%	23,24%	5,90%	6,91%	50,57%	-	2,00%	6,051%	23,88%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,78%	15,48%	5,55%	4,39%	27,92%	52,68%	0,50%	6,223%	15,08%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,76%	5,08%	2,96%	4,05%	-	-	1,60%	0,296%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,53%	3,15%	1,55%	2,58%	7,07%	-	1,60%	0,099%	1,79%
IGCT	0,81%	16,40%	6,54%	5,27%	32,63%	55,73%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	0,74%	15,97%	6,35%	4,95%	31,96%	54,40%	0,90%	6,375%	15,79%

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

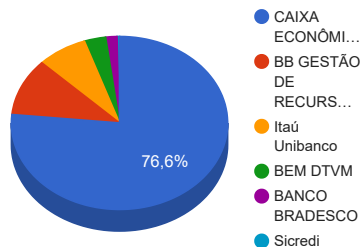
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,41%	4,59%	1,88%	3,75%	7,15%	16,20%	0,60%	0,261%	1,39%

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

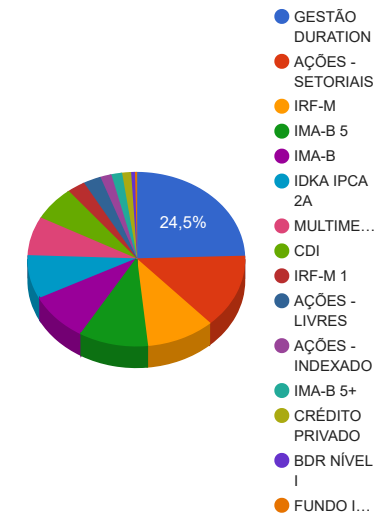
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	1,37%	17,65%	-1,78%	16,81%	9,81%	53,27%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1,30%	17,05%	-1,83%	16,28%	8,92%	49,37%	0,70%	4,346%	25,64%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	66.889.350,56	76,56%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.333.030,16	10,68%
Itaú Unibanco	6.545.762,32	7,49%
BEM DTVM	2.809.775,47	3,22%
BANCO BRADESCO	1.471.192,93	1,68%
Sicredi	324.260,56	0,37%

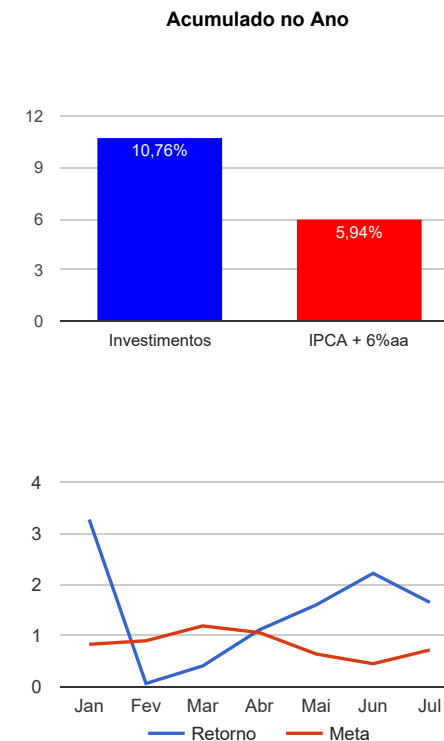


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	21.413.293,60	24,51%
AÇÕES - SETORIAIS	11.969.995,41	13,70%
IRF-M	8.894.336,27	10,18%
IMA-B 5	8.849.588,26	10,13%
IMA-B	7.839.655,59	8,97%
IDKA IPCA 2A	7.084.827,31	8,11%
MULTIMERCADO	6.294.657,09	7,20%
CDI	5.596.013,37	6,40%
IRF-M 1	2.350.237,70	2,69%
AÇÕES - LIVRES	2.294.648,49	2,63%
AÇÕES - INDEXADO	1.452.449,13	1,66%
IMA-B 5+	1.400.267,00	1,60%
CRÉDITO PRIVADO	1.160.743,18	1,33%
BDR NÍVEL I	493.064,16	0,56%
FUNDO IMOBILIÁRIO	279.595,44	0,32%



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	3.687.110,62	4.946.444,97	87.373.372,00	1.438.516,72	1,65%	0,72%	227,79%	1,70%
Acumulado no ano					8.616.356,20	10,76%	5,94%	181,13%	



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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	100.502,79	30.002,83	199.313,74	101.205,49	170.013,61	130,27%	0,12%	0,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	770.179,47	0,00	0,00	779.989,35	9.809,88	1,27%	1,34%	1,27%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.150.142,39	0,00	0,00	1.164.626,61	14.484,22	1,26%	1,33%	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.798.611,27	0,00	0,00	8.894.336,27	95.725,00	1,09%	0,64%	1,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.362.732,26	477.335,77	0,00	18.034.116,67	194.048,64	1,09%	1,03%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	806.990,61	0,00	0,00	815.144,08	8.153,47	1,01%	0,88%	1,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	78.264,21	0,00	0,00	79.032,90	768,69	0,98%	0,58%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.525.245,93	0,00	0,00	1.540.026,57	14.780,64	0,97%	0,79%	0,97%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.274.260,02	0,00	0,00	1.286.422,26	12.162,24	0,95%	1,22%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.347.465,46	0,00	0,00	3.379.176,93	31.711,47	0,95%	0,57%	0,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.609.304,88	0,00	0,00	7.681.379,62	72.074,74	0,95%	0,75%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.799.348,92	122.703,09	2.000.000,00	7.005.794,41	83.742,40	0,94%	0,58%	0,92%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.151.219,95	0,00	0,00	1.160.743,18	9.523,23	0,83%	0,57%	0,83%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.159.678,11	0,00	0,00	1.168.208,64	8.530,53	0,74%	0,38%	0,74%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	306.878,93	15.120,64	0,00	324.260,56	2.260,99	0,70%	0,15%	0,73%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.390.682,00	0,00	0,00	1.400.267,00	9.585,00	0,69%	0,06%	0,69%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.462.984,02	0,00	0,00	1.471.192,93	8.208,91	0,56%	0,00%	0,56%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.203.988,95	0,00	0,00	2.216.297,33	12.308,38	0,56%	0,01%	0,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.031.880,20	0,00	0,00	1.037.559,53	5.679,33	0,55%	0,00%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.031.419,07	33.410,09	199.313,74	870.963,58	5.448,16	0,51%	0,00%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.439.559,57	1.008.538,20	2.546.017,49	1.924.771,65	22.691,37	0,51%	0,12%	0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	244.807,49	2.000.000,00	0,00	2.253.446,72	8.639,23	0,38%	1,34%	1,27%
Total Renda Fixa					800.350,13	1,23%	0,72%	

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(%)
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.758.263,25	0,00	0,00	3.028.537,85	270.274,60	9,80%	7,36%	9,80%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.292.734,46	0,00	0,00	3.485.090,95	192.356,49	5,84%	5,73%	5,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.462.210,98	0,00	0,00	1.534.538,38	72.327,40	4,95%	6,18%	4,95%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	983.637,92	0,00	0,00	1.014.544,13	30.906,21	3,14%	6,02%	3,14%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	277.911,90	0,00	1.800,00	279.595,44	3.483,54	1,25%	-	0,00%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	751.803,79	0,00	0,00	760.110,11	8.306,32	1,10%	6,05%	1,10%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.441.181,66	0,00	0,00	1.452.449,13	11.267,47	0,78%	6,22%	0,78%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.115.866,84	0,00	0,00	1.124.360,16	8.493,32	0,76%	0,30%	0,76%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.620.080,12	0,00	0,00	1.632.047,01	11.966,89	0,74%	6,37%	0,74%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.212.380,20	0,00	0,00	2.224.077,47	11.697,27	0,53%	0,10%	0,53%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.934.152,57	0,00	0,00	2.946.219,46	12.066,89	0,41%	0,26%	0,41%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.811.073,40	0,00	0,00	2.809.775,47	-1.297,93	-0,05%	5,71%	-0,05%
Total Renda Variável					631.848,47	2,92%	4,51%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 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	486.746,04	0,00	0,00	493.064,16	6.318,12	1,30%	4,35%	1,30%
				Total Exterior	6.318,12	1,30%	4,35%	