

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

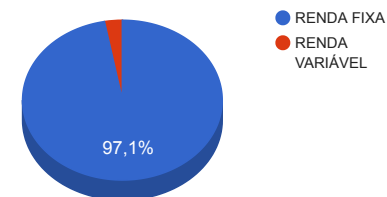
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.556.726,44	16,57%	546	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.154.977,22	14,70%	864	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.366.285,17	15,69%	1.439	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.309.582,04	15,42%	897	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.192.866,17	5,56%	377	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.934,16	0,01%	722	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.737.509,11	17,42%	830	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.519.076,85	11,74%	329	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	620.754,05	2,89%	98	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
		<b>Total</b>	<b>21.460.711,21</b>				

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

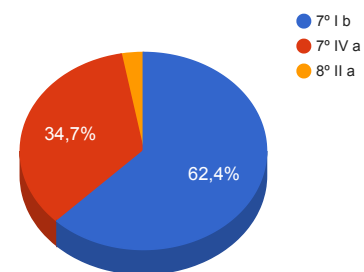
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	13.387.570,87	62,38%	15,00%	25,00%	100,00%	8.073.140,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	12.876.426,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.452.386,29	34,73%	5,00%	10,00%	40,00%	1.131.898,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	3.219.106,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.073.035,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.073.035,56
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	2.146.071,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	620.754,05	2,89%	0,00%	5,00%	10,00%	1.525.317,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,00%	10,00%	10,00%	2.146.071,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.073.035,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.073.035,56
<b>Total Carteira</b>		<b>21.460.711,21</b>					

RENDA FIXA	20.839.957,16	97,11%
RENDA VARIÁVEL	620.754,05	2,89%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	13.387.570,87	62,38%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.452.386,29	34,73%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	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 I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	620.754,05	2,89%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	3,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>21.460.711,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>39,00</b>	<b>270,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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	16.087.430,39	74,96%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.180.414,65	19,48%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.192.866,17	5,56%	0,00%

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

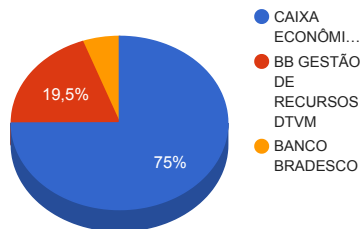
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,37%	4,95%	3,10%	6,27%	12,05%	24,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	4,70%	2,82%	5,91%	11,05%	22,36%	0,20%	0,634%	2,29%
IMA-B 5+	5,06%	21,12%	12,50%	21,12%	40,78%	49,39%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	5,04%	20,88%	12,40%	20,88%	40,14%	48,32%	0,20%	3,105%	11,68%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,04%	20,80%	12,35%	20,80%	40,18%	48,45%	0,20%	3,096%	11,68%
IRF-M 1	0,68%	2,72%	1,66%	3,30%	7,19%	15,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,64%	1,61%	3,20%	7,01%	15,56%	0,20%	0,098%	0,52%
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,54%	2,55%	1,52%	3,04%	6,22%	14,24%	0,20%	0,011%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	2,24%	1,33%	2,67%	5,49%	12,66%	0,80%	0,000%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	2,14%	1,27%	2,55%	5,24%	12,12%	1,00%	0,002%	0,01%
Selic	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,54%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,54%	2,56%	1,53%	3,06%	6,28%	14,67%	0,20%	0,005%	0,01%

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

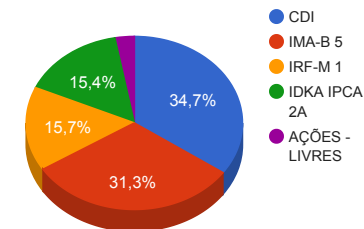
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,70%	10,40%	1,51%	8,41%	26,42%	54,73%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,80%	18,48%	6,13%	17,67%	42,05%	-	2,00%	8,754%	22,98%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.087.430,39	74,96%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.180.414,65	19,48%
BANCO BRADESCO	1.192.866,17	5,56%



Sub-segmento	Valor	%
CDI	7.452.386,29	34,73%
IMA-B 5	6.711.703,66	31,27%
IRF-M 1	3.366.285,17	15,69%
IDKA IPCA 2A	3.309.582,04	15,42%
AÇÕES - LIVRES	620.754,05	2,89%

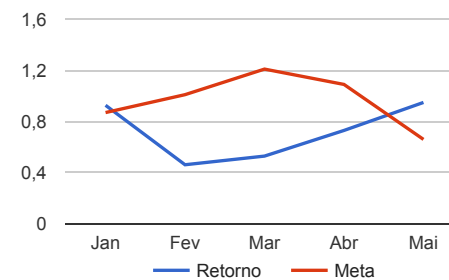
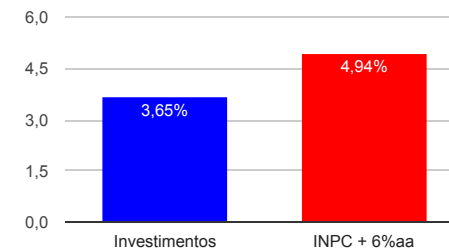




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.937.835,05	2.044.432,93	458.719,08	19.704.502,00	180.953,10	0,93%	0,87%	106,31%	0,35%
Fevereiro	19.704.502,00	1.625.481,07	1.893.265,75	19.527.681,98	90.964,66	0,46%	1,01%	45,89%	0,38%
Março	19.527.681,98	3.176.572,77	1.881.420,37	20.933.067,98	110.233,60	0,53%	1,21%	43,62%	0,54%
Abril	20.933.067,98	4.519.967,47	4.463.265,21	21.143.008,82	153.238,58	0,73%	1,09%	67,00%	0,30%
Mai	21.143.008,82	2.684.456,14	2.568.515,11	21.460.711,21	201.761,36	0,95%	0,66%	143,63%	0,64%
Acumulado no ano					737.151,30	3,65%	4,94%	73,91%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.508.505,76	0,00	0,00	3.556.726,44	48.220,68	1,37%	0,85%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.112.329,88	0,00	0,00	3.154.977,22	42.647,34	1,37%	0,86%	1,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.274.746,80	0,00	0,00	3.309.582,04	34.835,24	1,06%	0,63%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.344.407,29	0,00	0,00	3.366.285,17	21.877,88	0,65%	0,10%	0,65%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.186.449,03	0,00	0,00	1.192.866,17	6.417,14	0,54%	0,00%	0,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.717.585,74	0,00	0,00	3.737.509,11	19.923,37	0,54%	0,01%	0,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.921,04	0,00	0,00	2.934,16	13,12	0,45%	0,00%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.996.063,28	2.084.456,14	2.568.515,11	2.519.076,85	7.072,54	0,14%	0,00%	0,47%
Total Renda Fixa					181.007,31	0,86%	0,39%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	600.000,00	0,00	620.754,05	20.754,05	3,46%	8,75%	1,80%
Total Renda Variável					20.754,05	3,46%	8,75%	