

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

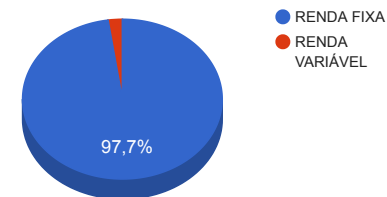
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	807.319,53	16,12%	57	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	302.289,66	6,04%	700	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	339.545,83	6,78%	64	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	707.174,02	14,12%	605	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	765.682,74	15,29%	1.390	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	590.693,12	11,79%	110	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	467.451,70	9,33%	116	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	913.078,35	18,23%	271	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	75.359,21	1,50%	151	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	40.089,02	0,80%	2.045	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
Total			5.008.683,18				

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

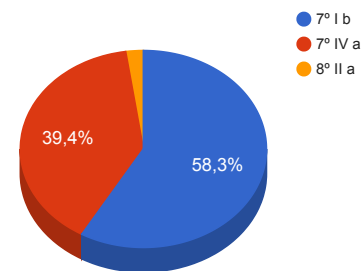
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	2.922.011,78	58,34%	0,00%	25,00%	100,00%	2.086.671,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	3.005.209,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	1.971.223,17	39,36%	0,00%	30,00%	40,00%	32.250,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	250.434,16
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	115.448,23	2,30%	0,00%	10,00%	20,00%	886.288,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	500.868,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	250.434,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	250.434,16
Total Carteira		5.008.683,18					

RENDA FIXA	4.893.234,95	97,70%
RENDA VARIÁVEL	115.448,23	2,30%

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 "	2.922.011,78	58,34%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.971.223,17	39,36%	0,00%	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 "	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 "	115.448,23	2,30%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	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%
Total	5.008.683,18	100,00%	0,00	270,00

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
ITAÚ UNIBANCO	2.602.754,62	51,96%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.009.463,68	20,15%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	805.771,76	16,09%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	590.693,12	11,79%	0,00%

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

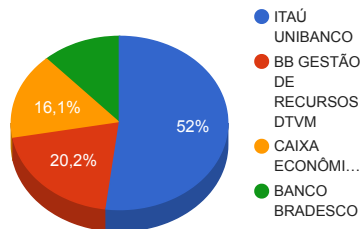
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,52%	4,50%	1,81%	3,45%	7,24%	14,42%	0,20%	0,181%	0,46%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,47%	4,45%	1,80%	3,40%	7,18%	14,26%	0,18%	0,183%	0,44%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,49%	4,10%	1,52%	3,04%	6,15%	13,26%	0,18%	0,003%	0,12%
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%
IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
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%
IMA-B 5	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,04%	8,18%	2,71%	6,04%	14,06%	21,16%	0,18%	1,025%	2,79%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,01%	8,23%	2,71%	6,03%	14,32%	21,44%	0,20%	1,061%	2,91%

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

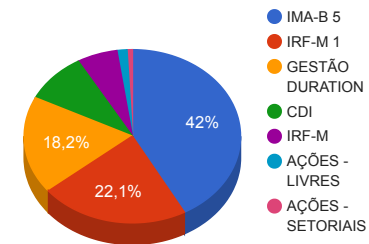
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	2,23%	24,66%	8,32%	13,12%	50,25%	50,69%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,72%	18,45%	7,85%	7,86%	41,81%	35,60%	1,50%	10,564%	17,81%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,58%	22,68%	11,81%	15,00%	47,57%	64,39%	2,50%	11,807%	15,46%

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

Administrador	Valor	%
ITAÚ UNIBANCO	2.602.754,62	51,96%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.009.463,68	20,15%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	805.771,76	16,09%
BANCO BRADESCO	590.693,12	11,79%



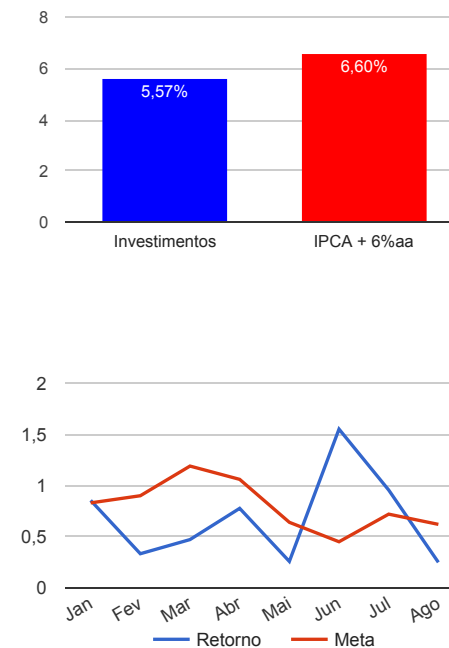
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	2.105.186,67	42,03%
IRF-M 1	1.105.228,57	22,07%
GESTÃO DURATION	913.078,35	18,23%
CDI	467.451,70	9,33%
IRF-M	302.289,66	6,04%
AÇÕES - LIVRES	75.359,21	1,50%
AÇÕES - SETORIAIS	40.089,02	0,80%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	444.663,75	1.989.972,50	400.000,00	2.052.022,36	17.386,11	0,85%	0,83%	102,75%	0,43%
Fevereiro	2.052.022,36	1.689.076,59	731.661,51	3.019.452,57	10.015,13	0,33%	0,90%	37,16%	0,69%
Março	3.019.452,57	0,00	620.780,02	2.412.899,21	14.226,66	0,47%	1,19%	39,47%	1,23%
Abril	2.412.899,21	868.787,69	409.000,00	2.894.994,68	22.307,78	0,78%	1,06%	73,29%	0,55%
Mai	2.894.994,68	14.486.396,73	13.103.990,05	4.322.175,49	44.774,13	0,26%	0,64%	40,21%	0,83%
Junho	4.322.175,49	400.000,00	400.000,00	4.389.231,01	67.055,52	1,55%	0,45%	344,50%	1,11%
Julho	4.389.231,01	831.935,99	828.895,85	4.434.243,83	41.972,68	0,96%	0,72%	131,94%	0,60%
Agosto	4.434.243,83	562.019,40	0,00	5.008.683,18	12.419,95	0,25%	0,62%	40,06%	0,90%
Acumulado no ano					230.157,96	5,57%	6,60%	84,47%	

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	761.684,17	0,00	0,00	765.682,74	3.998,57	0,52%	0,18%	0,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	465.152,48	0,00	0,00	467.451,70	2.299,22	0,49%	0,00%	0,49%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	337.958,04	0,00	0,00	339.545,83	1.587,79	0,47%	0,18%	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	780.576,03	130.000,00	0,00	913.078,35	2.502,32	0,27%	0,53%	0,32%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	301.572,22	0,00	0,00	302.289,66	717,44	0,24%	1,05%	0,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	706.932,62	0,00	0,00	707.174,02	241,40	0,03%	1,02%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	675.374,52	132.000,00	0,00	807.319,53	-54,99	-0,01%	1,02%	0,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	291.003,90	300.019,40	0,00	590.693,12	-330,18	-0,06%	1,06%	0,01%
Total Renda Fixa					10.961,57	0,22%	0,65%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	74.188,63	0,00	0,00	75.359,21	1.170,58	1,58%	11,81%	1,58%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	39.801,22	0,00	0,00	40.089,02	287,80	0,72%	10,56%	0,72%
Total Renda Variável					1.458,38	1,28%	11,38%	