

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.218.902,13	18,27%	879	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.016.483,32	1,66%	564	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.244.579,30	16,68%	943	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.569.950,15	2,56%	1.208	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.030.663,14	3,31%	668	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.560.454,41	20,45%	1.372	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.065.536,99	8,25%	383	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.061.947,18	3,36%	154	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	934.026,81	1,52%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	288.561,25	0,47%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.486.875,74	4,05%	326	0,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	773.011,90	1,26%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.508.510,47	2,46%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	2.278.383,86	3,71%	8	5,94%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	350.385,77	0,57%	67	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15 du	Não há	519.403,61	0,85%	40	0,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.009.946,36	1,64%	16.354	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.248.166,01	2,03%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	18.506,07	0,03%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.479.059,13	4,04%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	691.612,86	1,13%		0,30%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.042.829,74	1,70%		7,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2019)

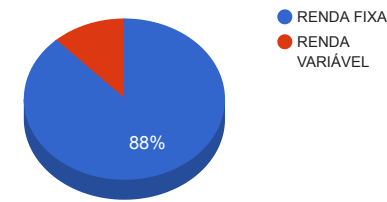
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
Total para cálculo dos limites da Resolução			61.397.796,20				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			18.613,78	Artigo 6º			
Total			61.416.409,98				

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

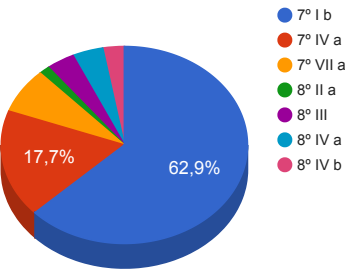
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	38.641.032,45	62,94%	15,00%	25,00%	70,00%	4.337.424,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	36.838.677,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	10.836.947,97	17,65%	10,00%	30,00%	40,00%	13.722.170,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.559.906,23	7,43%	2,00%	5,00%	5,00%	-1.490.016,42
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	869.789,38	1,42%	7,00%	10,00%	20,00%	11.409.769,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.276.618,44	3,71%	7,00%	10,00%	10,00%	3.863.161,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.479.059,13	4,04%	2,00%	5,00%	5,00%	590.830,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.734.442,60	2,82%	2,00%	5,00%	5,00%	1.335.447,21
Total Carteira		61.397.796,20					

RENDA FIXA	54.056.500,43	88,04%
RENDA VARIÁVEL	7.359.909,55	11,99%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Base: outubro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	38.641.032,45	62,92%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	10.836.947,97	17,65%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.559.906,23	7,42%	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 "	869.789,38	1,42%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.276.618,44	3,71%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.479.059,13	4,04%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.734.442,60	2,82%	2,00%	5,00%
Total	61.397.796,20	99,97%	50,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	33.917.459,55	55,23%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.155.721,37	23,05%	0,00%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	3.069.901,83	5,00%	1,43%
A5 CAPITAL PARTNERS	2.479.059,13	4,04%	-
Bradesco Asset Management	2.061.947,18	3,36%	0,00%
Aurora Capital	1.508.510,47	2,46%	2,05%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.248.166,01	2,03%	0,28%
Elleven Gestora de Recursos	1.222.588,06	1,99%	-
Um Asset	1.042.829,74	1,70%	-
ZION Invest	691.612,86	1,13%	0,14%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral ex-C	1,69%	12,40%	3,35%	8,30%	14,62%	24,51%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	13,06%	3,41%	8,88%	15,25%	25,21%	0,30%	0,927%	2,43%
IMA-B 5	1,65%	12,09%	3,47%	7,74%	13,78%	24,36%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,27%	4,50%	1,81%	5,25%	2,55%	-4,81%	0,70%	1,316%	4,68%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,73%	3,45%	1,18%	5,80%	4,53%	-15,05%	0,70%	1,283%	4,74%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	10,48%	2,93%	6,70%	12,06%	22,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	9,97%	2,82%	6,15%	11,39%	21,52%	0,20%	0,763%	1,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	9,71%	2,72%	5,87%	11,17%	21,20%	0,20%	0,815%	1,54%
IPCA + 8,00% ao ano	0,81%	9,46%	2,21%	4,57%	10,74%	24,97%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,57%	9,35%	2,16%	4,91%	-	25,08%	0,35%	0,135%	0,87%
IPCA + 7,00% ao ano	0,72%	8,61%	1,96%	4,07%	9,71%	22,68%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,69%	-10,00%	-4,29%	-2,42%	-8,75%	-25,25%	1,65%	0,362%	7,73%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,23%	1,42%	-1,12%	0,08%	3,46%	-1,65%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,62%	5,96%	1,83%	3,85%	7,13%	14,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	5,79%	1,77%	3,74%	6,93%	14,31%	0,20%	0,148%	0,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	5,75%	1,75%	3,71%	6,87%	14,19%	0,10%	0,149%	0,27%
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	5,17%	1,48%	3,12%	6,18%	12,91%	0,20%	0,041%	0,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,40%	4,43%	1,23%	2,62%	5,32%	11,29%	0,80%	0,000%	0,10%
IPCA	0,10%	2,60%	0,17%	0,50%	2,54%	7,21%	-	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,91%	12,54%	3,53%	8,56%	14,84%	-	0,40%	0,979%	2,34%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,71%	16,33%	3,73%	10,67%	18,32%	26,77%	0,002	1,122%	3,53%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	4,01%	18,73%	4,98%	11,30%	24,51%	25,41%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-

Ibovespa	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	2,59%	20,96%	5,64%	11,18%	20,74%	41,87%	1,00%	8,037%	9,86%

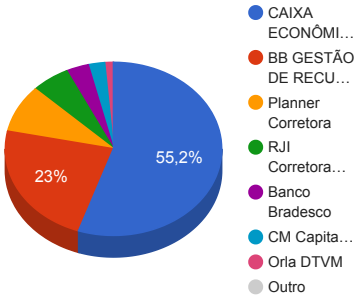
IPCA + 6,00% ao ano	0,63%	7,75%	1,71%	3,57%	8,69%	20,40%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,12%	-9,96%	-1,86%	-6,70%	-	-15,05%	1,50%	0,284%	4,85%

CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,87%	14,79%	3,01%	8,89%	16,83%	27,11%	0,50%	1,480%	3,40%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,92%	0,76%	-2,60%	-1,80%	3,33%	-94,61%	0,00%	2,237%	3,16%

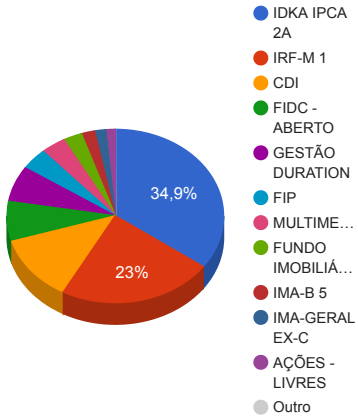
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	2,53%	-	1,42%	-	-	-	2,00%	7,610%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-12,42%	-22,09%	-15,72%	-12,99%	-29,10%	-32,32%	1,60%	17,729%	30,87%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.917.459,55	55,23%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.155.721,37	23,05%
Planner Corretora	5.449.055,85	8,87%
RJI Corretora de Valores	3.513.583,81	5,72%
Banco Bradesco	2.061.947,18	3,36%
CM Capital Markets DTVM	1.508.510,47	2,46%
Orla DTVM	791.517,97	1,29%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	18.613,78	0,03%

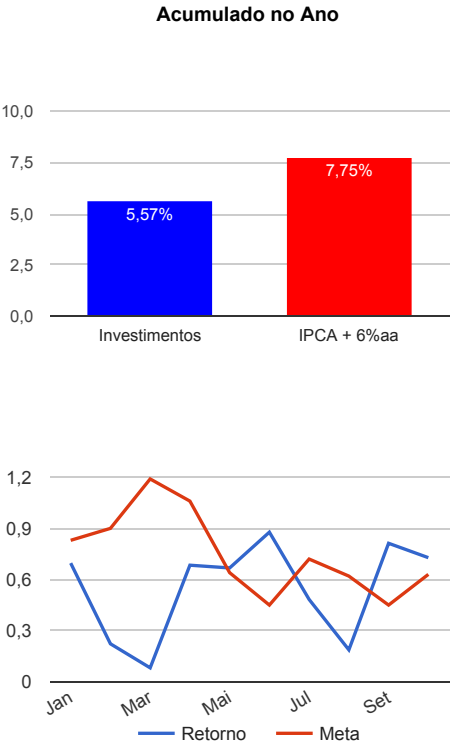


Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	21.463.481,43	34,95%
IRF-M 1	14.130.404,56	23,01%
CDI	7.552.412,73	12,30%
FIDC - ABERTO	4.559.906,23	7,42%
GESTÃO DURATION	4.092.610,32	6,66%
FIP	2.479.059,13	4,04%
MULTIMERCADO	2.276.618,44	3,71%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.734.442,60	2,82%
IMA-B 5	1.222.588,06	1,99%
IMA-GERAL EX-C	1.016.483,32	1,66%
AÇÕES - LIVRES	869.789,38	1,42%
DISP. FINANCEIRA	18.613,78	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	55.923.584,98	1.114.829,27	909.763,42	56.519.386,60	390.735,77	0,70%	0,83%	83,71%	0,75%
Fevereiro	56.519.386,60	462.397,30	258.675,66	56.849.438,45	126.330,21	0,22%	0,90%	24,87%	0,59%
Março	56.849.438,45	435.288,98	244.593,27	57.086.706,06	46.571,90	0,08%	1,19%	6,84%	0,98%
Abril	57.086.706,06	439.864,14	243.962,78	57.674.392,84	391.785,42	0,68%	1,06%	64,55%	0,59%
Mai	57.674.392,84	6.249.593,03	5.991.565,38	58.319.294,85	386.874,36	0,67%	0,64%	104,24%	0,69%
Junho	58.319.294,85	9.152.202,20	8.909.180,97	59.076.362,12	514.046,04	0,88%	0,45%	194,91%	1,47%
Julho	59.076.362,12	502.096,57	289.611,02	59.575.248,97	286.401,30	0,48%	0,72%	66,70%	0,85%
Agosto	59.575.248,97	2.705.734,79	2.355.241,65	60.037.971,52	112.229,41	0,19%	0,62%	30,18%	1,49%
Setembro	60.037.971,52	479.251,73	267.548,64	60.739.216,04	489.541,43	0,81%	0,45%	181,95%	0,97%
Outubro	60.739.216,04	5.031.945,97	4.817.206,45	61.397.796,20	443.840,64	0,73%	0,63%	114,89%	0,84%
Acumulado no ano					3.188.356,48	5,57%	7,75%	71,89%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.023.338,03	0,00	0,00	2.061.947,18	38.609,15	1,91%	0,98%	1,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.483,32	16.483,32	1,65%	0,93%	1,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.030.663,14	30.663,14	1,53%	1,12%	1,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.115.449,85	0,00	0,00	10.244.579,30	129.129,45	1,28%	0,76%	1,28%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	284.941,02	0,00	0,00	288.561,25	3.620,23	1,27%	1,32%	1,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.081.627,74	0,00	0,00	11.218.902,13	137.274,39	1,24%	0,82%	1,24%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	927.302,04	0,00	0,00	934.026,81	6.724,77	0,73%	1,28%	0,73%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.262.337,51	0,00	0,00	2.278.383,86	16.046,35	0,71%	0,13%	0,57%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.498.182,94	0,00	0,00	1.508.510,47	10.327,53	0,69%	0,36%	0,69%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.484.694,84	0,00	0,00	12.560.454,41	75.759,57	0,61%	0,15%	0,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.559.609,34	0,00	1.000.000,00	1.569.950,15	10.340,81	0,40%	0,15%	0,60%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.262.383,13	531.945,97	317.206,45	2.486.875,74	9.753,09	0,35%	0,00%	0,40%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.538.337,55	0,00	3.500.000,00	5.065.536,99	27.199,44	0,32%	0,04%	0,50%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	774.784,83	0,00	0,00	773.011,90	-1.772,93	-0,23%	-	-
Total Renda Fixa					510.158,31	0,93%	0,51%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	519.403,61	19.403,61	3,88%	7,61%	2,53%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	341.534,67	0,00	0,00	350.385,77	8.851,10	2,59%	8,04%	2,59%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.009.946,36	9.946,36	0,99%	1,48%	0,87%
HAZ FII - ATCR11	1.043.098,36	0,00	0,00	1.042.829,74	-268,62	-0,03%	-	0,00%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.249.693,33	0,00	0,00	1.248.166,01	-1.527,32	-0,12%	0,28%	-0,12%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	2.483.545,71	0,00	0,00	2.479.059,13	-4.486,58	-0,18%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.677,78	0,00	0,00	18.506,07	-171,71	-0,92%	2,24%	-0,92%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	789.677,37	0,00	0,00	691.612,86	-98.064,51	-12,42%	17,73%	-12,42%
Total Renda Variável					-66.317,67	-0,89%	5,45%	