

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

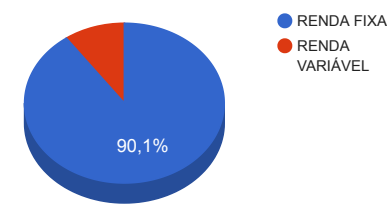
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			84,59	0,00%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.085.686,23	26,16%	1.449	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.482.858,31	4,30%	1.248	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.550.938,18	26,96%	838	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.734.259,98	3,01%	852	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	2.838.769,08	4,92%	15.761	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	282.934,69	0,49%	774	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.320.970,05	14,43%	415	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	274.160,60	0,48%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	34.597,35	0,06%	716	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	882.842,66	1,53%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.545.928,15	2,68%	33	0,74%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	772.414,69	1,34%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	2.168.750,58	3,76%	8	5,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	18.844,68	0,03%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.337.740,45	2,32%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.504.522,31	4,34%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	794.838,66	1,38%		0,50%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.043.336,19	1,81%		7,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>57.674.477,43</b>				

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

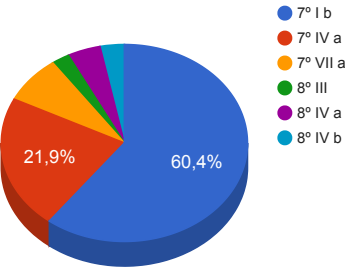
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	34.853.742,70	60,43%	15,00%	25,00%	70,00%	5.518.391,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	34.604.686,46
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	12.634.274,43	21,91%	10,00%	30,00%	40,00%	10.435.516,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.487.093,42	7,78%	2,00%	5,00%	5,00%	-1.603.369,55
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	11.534.895,49
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.356.585,13	2,35%	7,00%	10,00%	10,00%	4.410.862,61
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.504.522,31	4,34%	2,00%	5,00%	5,00%	379.201,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.838.174,85	3,19%	2,00%	5,00%	5,00%	1.045.549,02
Total Carteira		57.674.392,84					

RENDA FIXA	51.975.195,14	90,12%
RENDA VARIÁVEL	5.699.282,29	9,88%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	34.853.742,70	60,43%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.634.274,43	21,91%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.487.093,42	7,78%	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 "	0,00	0,00%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.356.585,13	2,35%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.504.522,31	4,34%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.838.174,85	3,19%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	57.674.392,84	100,00%	50,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 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	27.979.685,34	48,51%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.351.328,53	31,82%	0,00%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	2.960.009,95	5,13%	0,47%
A5 CAPITAL PARTNERS	2.504.522,31	4,34%	-
Elleven Gestora de Recursos	2.200.339,45	3,82%	0,12%
SUPERNOVA CAPITAL	1.545.928,15	2,68%	-
RJI Gestão & Investimentos	1.337.740,45	2,32%	-
ZION Invest	794.838,66	1,38%	0,16%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	1,22%	4,67%	3,64%	5,90%	13,27%	24,98%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	1,58%	4,24%	3,33%	-	12,78%	25,00%	0,35%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano	1,14%	4,36%	3,41%	5,42%	12,23%	22,71%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,45%	1,34%	0,49%	3,38%	1.214,73%	-47,62%	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,43%	-7,77%	-6,35%	-6,49%	-6,87%	-22,52%	1,65%	0,388%	13,86%
IMA-B 5	1,11%	4,03%	2,46%	5,60%	9,94%	22,26%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,66%	-0,71%	-1,99%	-2,57%	-13,48%	-7,47%	0,70%	0,574%	9,28%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,42%	-2,22%	-2,37%	-1,20%	-16,98%	-17,33%	0,70%	0,502%	13,28%
IDKA IPCA 2 Anos	1,03%	3,54%	2,25%	5,02%	9,41%	22,74%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,62%	2,38%	5,01%	9,10%	21,55%	0,20%	0,564%	2,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	3,60%	2,30%	4,94%	9,02%	21,57%	0,20%	0,565%	2,36%
CDI	0,52%	2,04%	1,49%	3,05%	6,34%	15,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	1,99%	1,45%	2,97%	6,12%	14,58%	0,20%	0,036%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	2,00%	1,46%	2,98%	6,22%	14,92%	0,20%	0,010%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,68%	1,23%	2,51%	5,21%	12,54%	1,00%	0,002%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,10%	0,39%	0,28%	0,58%	1,18%	4,10%	5,00%	0,000%	0,00%
IRF-M 1	0,50%	2,03%	1,45%	3,16%	6,68%	16,65%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	1,98%	1,40%	3,07%	6,52%	15,85%	0,20%	0,082%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,97%	1,38%	3,05%	6,47%	15,74%	0,10%	0,087%	0,55%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

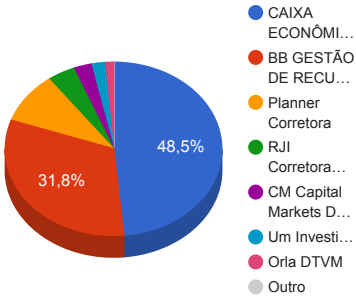
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,06%	4,04%	3,18%	4,94%	11,19%	20,46%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,20%	-3,50%	-3,31%	-	-8,57%	-3,04%	1,50%	1,024%	-
IFIX	1,03%	6,67%	4,10%	11,86%	7,32%	22,14%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
CDI	0,52%	2,04%	1,49%	3,05%	6,34%	15,26%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,94%	2,60%	2,46%	5,22%	-94,76%	-94,22%	0,00%	0,110%	95,48%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	4,05%	-10,47%	-12,00%	-18,52%	-30,94%	2,67%	1,60%	20,077%	42,28%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

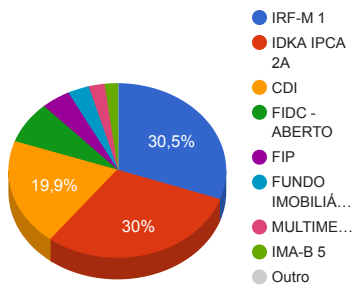


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.979.685,34	48,51%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.351.328,53	31,82%
Planner Corretora	5.468.111,55	9,48%
RJI Corretora de Valores	2.381.076,64	4,13%
CM Capital Markets DTVM	1.545.928,15	2,68%
Um Investimentos	1.157.003,26	2,01%
Orla DTVM	791.259,37	1,37%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	84,59	0,00%

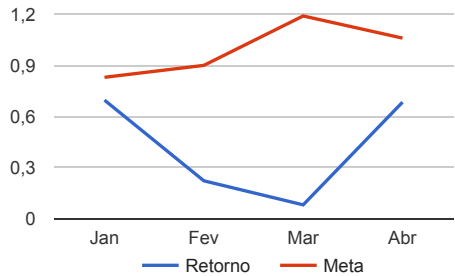
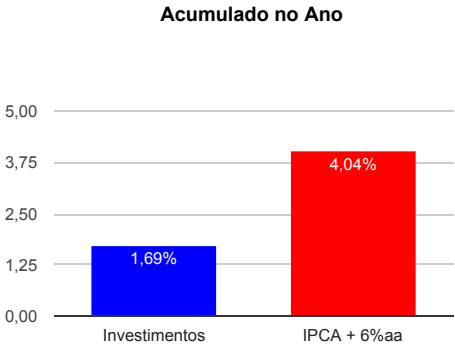


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	17.568.544,54	30,46%
IDKA IPCA 2A	17.285.198,16	29,97%
CDI	11.477.271,17	19,90%
FIDC - ABERTO	4.487.093,42	7,78%
FIP	2.504.522,31	4,34%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.838.174,85	3,19%
MULTIMERCADO	1.356.585,13	2,35%
IMA-B 5	1.157.003,26	2,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	84,59	0,00%



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%
Acumulado no ano					955.423,30	1,69%	4,04%	41,92%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.139.834,27	0,00	0,00	2.168.750,58	28.916,31	1,35%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.381.017,64	0,00	0,00	15.550.938,18	169.920,54	1,10%	0,56%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.715.935,87	0,00	0,00	1.734.259,98	18.324,11	1,07%	0,56%	1,07%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	272.370,60	0,00	0,00	274.160,60	1.790,00	0,66%	0,57%	0,66%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.277.916,28	0,00	0,00	8.320.970,05	43.053,77	0,52%	0,04%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	281.506,37	0,00	0,00	282.934,69	1.428,32	0,51%	0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.010.412,80	0,00	0,00	15.085.686,23	75.273,43	0,50%	0,08%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.470.547,07	0,00	0,00	2.482.858,31	12.311,24	0,50%	0,09%	0,50%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	768.975,35	0,00	0,00	772.414,69	3.439,34	0,45%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.449,37	0,00	0,00	34.597,35	147,98	0,43%	0,00%	0,43%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.539.381,66	0,00	0,00	1.545.928,15	6.546,49	0,43%	0,39%	0,71%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	879.109,25	0,00	0,00	882.842,66	3.733,41	0,42%	0,50%	0,42%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.640.092,77	439.864,14	243.962,78	2.838.769,08	2.774,95	0,09%	0,00%	0,10%
Total Renda Fixa					367.659,89	0,71%	0,26%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	763.870,92	0,00	0,00	794.838,66	30.967,74	4,05%	20,08%	4,05%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.669,23	0,00	0,00	18.844,68	175,45	0,94%	0,11%	0,94%
HAZ FII - ATCR11	1.043.574,64	0,00	0,00	1.043.336,19	-238,45	-0,02%	-	0,00%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.508.660,67	0,00	0,00	2.504.522,31	-4.138,36	-0,16%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.340.381,30	0,00	0,00	1.337.740,45	-2.640,85	-0,20%	1,02%	-0,19%
Total Renda Variável					24.125,53	0,43%	8,05%	