

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

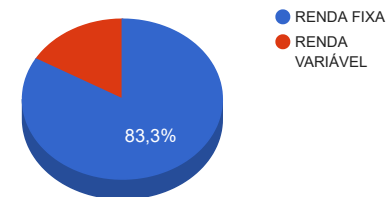
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.082.118,76	2,47%	611	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.708.541,70	3,90%	966	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	3.299.609,82	7,53%	668	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.251.071,52	2,86%	716	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.191.416,78	7,28%	943	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.636.020,88	10,58%	879	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.144.550,83	4,89%	117	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.852.286,26	11,08%	689	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	2.435.611,82	5,56%	396	0,59%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	3.981.782,44	9,09%	323	1,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.642.534,70	3,75%	95	0,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.177.858,45	7,25%	54	0,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	98.936,68	0,23%	733	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.261.780,58	5,16%	738	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	749.729,84	1,71%	98	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	554.490,52	1,27%	89	0,07%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23 DU	Não há	280.145,91	0,64%	74	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.462.163,20	5,62%	1.178	2,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	271.461,86	0,62%	135	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.303.910,39	2,98%	7.115	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.426.423,71	5,54%	77	1,63%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total</b>			<b>43.812.446,65</b>				

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

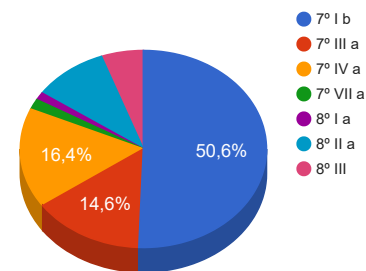
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	22.165.616,55	50,59%	15,00%	2,50%	70,00%	8.503.096,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	6.417.394,26	14,65%	5,00%	10,00%	60,00%	19.870.073,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.181.110,41	16,39%	10,00%	30,00%	40,00%	10.343.868,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	749.729,84	1,71%	0,00%	5,00%	5,00%	1.440.892,49
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	554.490,52	1,27%	0,00%	5,00%	5,00%	1.636.131,81
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.317.681,36	9,85%	7,00%	10,00%	20,00%	4.444.807,97
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.426.423,71	5,54%	7,00%	10,00%	10,00%	1.954.820,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.190.622,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.190.622,33
Total Carteira		43.812.446,65					

RENDA FIXA	36.513.851,06	83,34%
RENDA VARIÁVEL	7.298.595,59	16,66%

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 "	22.165.616,55	50,59%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.417.394,26	14,65%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.181.110,41	16,39%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	749.729,84	1,71%	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 "	554.490,52	1,27%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.317.681,36	9,85%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.426.423,71	5,54%	7,00%	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</b>	<b>43.812.446,65</b>	<b>100,00%</b>	<b>44,00</b>	<b>245,00</b>

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.920.434,10	27,21%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.015.839,40	25,14%	0,00%
SICREDI	6.417.394,26	14,65%	0,02%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.322.409,28	12,15%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	4.068.958,41	9,29%	0,54%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.462.163,20	5,62%	0,05%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.303.910,39	2,98%	0,00%
PETRA Capital	749.729,84	1,71%	0,01%
VINCI PARTNERS	551.607,77	1,26%	0,00%

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-B 5+	4,67%	32,45%	7,73%	20,86%	37,00%	51,90%	-	-	-
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,69%	32,05%	7,68%	20,68%	36,54%	50,90%	0,20%	2,812%	8,00%
IMA-B	3,36%	23,57%	5,89%	15,34%	26,74%	39,79%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,49%	23,49%	6,13%	15,58%	26,78%	39,70%	0,20%	1,988%	5,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,35%	23,33%	5,86%	15,22%	26,46%	39,10%	0,20%	1,930%	5,32%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,33%	23,21%	5,81%	15,12%	26,30%	38,82%	0,20%	1,921%	5,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,33%	23,33%	5,82%	15,17%	26,47%	39,19%	0,20%	1,925%	5,33%
IRF-M	1,70%	11,85%	3,43%	8,70%	14,69%	25,51%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	1,80%	12,04%	3,49%	8,91%	14,88%	25,80%	0,20%	1,022%	2,28%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,68%	11,65%	3,37%	8,58%	14,44%	25,00%	0,20%	0,953%	2,13%
IMA-B 5	1,65%	12,09%	3,47%	7,74%	13,78%	24,36%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,64%	11,90%	3,43%	7,66%	13,56%	23,88%	0,20%	0,987%	2,06%
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%
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	0,82%	5,94%	1,85%	3,70%	7,02%	14,88%	0,75%	0,287%	0,56%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	5,02%	1,39%	2,96%	6,04%	12,77%	0,20%	0,008%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	4,21%	1,17%	2,49%	5,06%	10,74%	1,00%	0,003%	0,10%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,47%	6,13%	1,22%	2,59%	6,74%	16,16%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-8,80%	-0,49%	-7,03%	-9,16%	-14,18%	0,15%	0,025%	6,04%
IPCA	0,10%	2,60%	0,17%	0,50%	2,54%	7,21%	-	-	-
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%

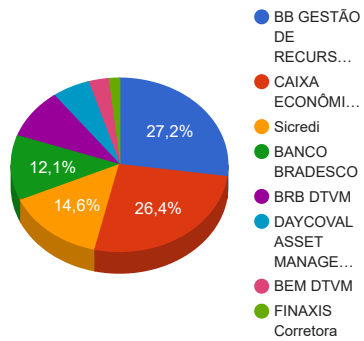
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	3,14%	25,40%	6,64%	14,14%	27,30%	51,44%	2,50%	8,122%	10,90%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,05%	31,25%	6,21%	19,22%	46,15%	57,08%	1,72%	6,738%	14,37%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2,27%	20,34%	5,38%	13,67%	21,94%	52,87%	2,00%	7,847%	8,63%
IBX-50	2,18%	20,18%	4,87%	10,15%	20,18%	41,48%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	2,19%	19,63%	4,87%	10,53%	19,06%	37,79%	0,70%	8,566%	12,01%
IDIV	1,52%	28,95%	5,74%	15,57%	39,23%	46,45%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3,46%	30,23%	6,48%	13,96%	41,82%	47,05%	1,72%	6,695%	12,28%
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,68%	5,78%	1,60%	3,59%	6,75%	14,28%	1,00%	0,213%	0,54%

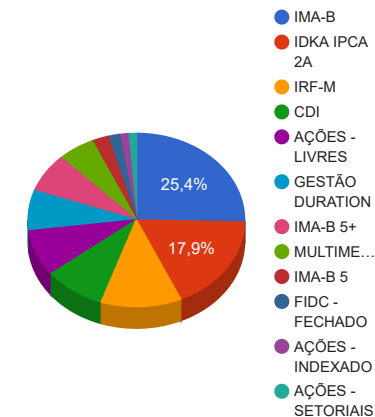


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (outubro / 2019)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.920.434,10	27,21%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.567.447,17	26,40%
Sicredi	6.417.394,26	14,65%
BANCO BRADESCO	5.322.409,28	12,15%
BRB DTVM	4.068.958,41	9,29%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	2.462.163,20	5,62%
BEM DTVM	1.303.910,39	2,98%
FINAXIS Corretora	749.729,84	1,71%



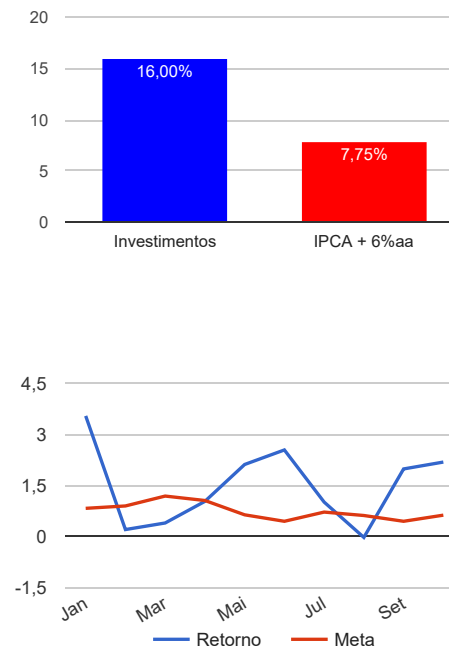
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.140.990,61	25,43%
IDKA IPCA 2A	7.827.437,66	17,87%
IRF-M	5.232.853,96	11,94%
CDI	4.003.251,96	9,14%
AÇÕES - LIVRES	3.766.073,59	8,60%
GESTÃO DURATION	3.299.609,82	7,53%
IMA-B 5+	3.177.858,45	7,25%
MULTIMERCADO	2.426.423,71	5,54%
IMA-B 5	1.082.118,76	2,47%
FIDC - FECHADO	749.729,84	1,71%
AÇÕES - INDEXADO	554.490,52	1,27%
AÇÕES - SETORIAIS	551.607,77	1,26%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	35.914.251,05	742.597,86	754.105,40	37.174.684,28	1.271.940,77	3,54%	0,83%	425,87%	2,01%
Fevereiro	37.174.684,28	935.345,64	752.933,09	37.434.589,67	77.492,84	0,21%	0,90%	23,16%	2,43%
Março	37.434.589,67	1.625.893,27	1.298.590,99	37.913.077,74	151.185,79	0,40%	1,19%	33,54%	3,65%
Abril	37.913.077,74	1.363.635,44	1.089.434,68	38.582.443,18	395.164,68	1,03%	1,06%	97,67%	1,85%
Mai	38.582.443,18	7.411.373,57	7.043.032,97	39.775.279,77	824.495,99	2,12%	0,64%	330,41%	5,76%
Junho	39.775.279,77	3.589.042,67	3.328.329,06	41.054.118,20	1.018.124,82	2,54%	0,45%	564,69%	2,11%
Julho	41.054.118,20	1.384.900,22	1.090.076,71	41.768.170,30	419.228,59	1,01%	0,72%	139,99%	1,49%
Agosto	41.768.170,30	813.067,41	858.662,45	41.712.905,57	-9.669,69	-0,02%	0,62%	-3,73%	2,64%
Setembro	41.712.905,57	963.832,78	863.154,71	42.643.991,93	830.408,29	1,99%	0,45%	444,73%	1,71%
Outubro	42.643.991,93	1.476.017,13	1.245.541,24	43.812.446,65	937.978,83	2,19%	0,63%	345,19%	1,97%
Acumulado no ano					5.916.350,91	16,00%	7,75%	206,36%	

Acumulado no Ano



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(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.035.434,78	0,00	0,00	3.177.858,45	142.423,67	4,69%	2,81%	4,69%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.353.525,82	0,00	0,00	2.435.611,82	82.086,00	3,49%	1,99%	3,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.694.835,96	0,00	0,00	4.852.286,26	157.450,30	3,35%	1,93%	3,35%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.075.340,56	0,00	0,00	2.144.550,83	69.210,27	3,33%	1,92%	3,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.653.555,26	0,00	0,00	1.708.541,70	54.986,44	3,33%	1,92%	3,33%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	3.911.316,93	0,00	0,00	3.981.782,44	70.465,51	1,80%	1,02%	1,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	3.244.123,85	0,00	0,00	3.299.609,82	55.485,97	1,71%	1,12%	1,71%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.230.363,13	0,00	0,00	1.251.071,52	20.708,39	1,68%	0,95%	1,68%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.064.644,47	0,00	0,00	1.082.118,76	17.474,29	1,64%	0,99%	1,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.151.190,05	0,00	0,00	3.191.416,78	40.226,73	1,28%	0,76%	1,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.233.150,89	378.387,06	30.000,00	4.636.020,88	54.482,93	1,18%	0,82%	1,24%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	1.629.200,61	0,00	0,00	1.642.534,70	13.334,09	0,82%	0,29%	0,82%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.251.659,67	0,00	0,00	2.261.780,58	10.120,91	0,45%	0,01%	0,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	215.689,03	1.097.630,07	1.215.541,24	98.936,68	1.158,82	0,09%	0,00%	0,38%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	750.949,24	0,00	0,00	749.729,84	-1.219,40	-0,16%	0,02%	-0,16%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>788.394,92</b>	<b>2,21%</b>	<b>1,30%</b>	

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 VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	262.392,25	0,00	0,00	271.461,86	9.069,61	3,46%	6,69%	3,46%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2.387.239,93	0,00	0,00	2.462.163,20	74.923,27	3,14%	8,12%	3,14%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	271.860,84	0,00	0,00	280.145,91	8.285,07	3,05%	6,74%	3,05%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.274.946,39	0,00	0,00	1.303.910,39	28.964,00	2,27%	7,85%	2,27%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	542.601,07	0,00	0,00	554.490,52	11.889,45	2,19%	8,57%	2,19%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.409.971,20	0,00	0,00	2.426.423,71	16.452,51	0,68%	0,21%	0,68%
Total Renda Variável					149.583,91	2,09%	5,37%	