

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 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	8.117.471,28	4,18%	875	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	383.852,66	0,20%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.096.756,89	1,08%	417	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	4.177.494,64	2,15%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.539.555,55	1,31%	700	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	37.046.483,89	19,10%	630	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.988.349,74	7,73%	915	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.457.220,75	6,94%	940	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	7.679.860,19	3,96%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.376.795,51	4,32%	1.214	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.475.025,45	2,82%	605	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	12.616.483,35	6,50%	542	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.849.446,30	2,50%	962	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.085.406,29	2,11%	136	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.832.223,55	0,94%	271	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.302.185,62	1,70%	51	1,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.423.871,17	6,40%	56	3,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.789.171,41	1,95%	733	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	253.102,11	0,13%	353	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	4.697.830,41	2,42%	46.226	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	3.023.197,22	1,56%	169	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	7.338.896,73	3,78%	203	0,94%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

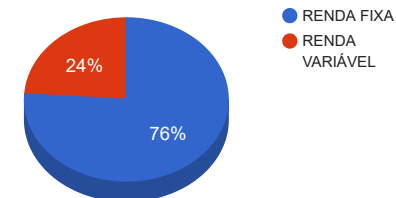
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.573.062,53	6,48%	4.051	2,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.963.673,37	4,11%	10.173	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.287.760,03	1,69%	77	2,23%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.038.033,59	0,54%	36	0,31%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.903.715,78	2,01%	6.716	0,53%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	2.674.284,60	1,38%		1,65%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			193.991.210,61				

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

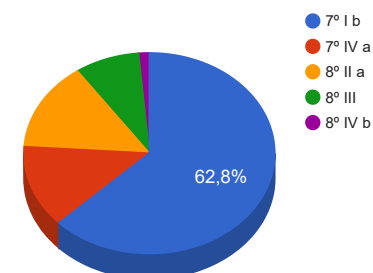
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	121.804.796,20	62,79%	15,00%	40,00%	90,00%	52.787.293,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	116.394.726,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	25.685.960,15	13,24%	5,00%	29,00%	40,00%	51.910.524,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	9.699.560,53
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	38.798.242,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	27.632.986,89	14,24%	0,00%	10,00%	20,00%	11.165.255,23
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	16.193.182,77	8,35%	0,00%	5,00%	10,00%	3.205.938,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	9.699.560,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.674.284,60	1,38%	0,00%	2,50%	5,00%	7.025.275,93
Total Carteira		193.991.210,61					

RENDA FIXA	147.490.756,35	76,03%
RENDA VARIÁVEL	46.500.454,26	23,97%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	121.804.796,20	62,79%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	25.685.960,15	13,24%	5,00%	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 I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	27.632.986,89	14,24%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	16.193.182,77	8,35%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.674.284,60	1,38%	0,00%	5,00%
Total	193.991.210,61	100,00%	20,00	285,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	113.078.724,83	58,29%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.499.047,07	25,00%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.677.405,13	6,02%	0,00%
ITAU UNIBANCO	6.530.053,96	3,37%	0,00%
WESTERN ASSET	3.903.715,78	2,01%	0,01%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	3.302.185,62	1,70%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.287.760,03	1,69%	0,47%
ZION Invest	2.674.284,60	1,38%	0,54%
BANCO J. SAFRA S/A	1.038.033,59	0,54%	0,00%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '1266' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rf.asp, line 62