

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
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.805.671,74	7,01%	417	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	17.293.704,75	11,22%	542	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	4.489.474,45	2,91%	630	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	5.025.847,64	3,26%	333	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.622.753,40	7,54%	962	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.639.287,82	4,31%	1.390	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.184.012,31	8,55%	605	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.379.659,36	10,62%	940	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.321.593,67	0,86%	78	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	373.387,22	0,24%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.255.369,70	0,81%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.390.798,72	5,44%	875	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.715.214,99	2,41%	1.214	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.840.969,30	5,73%	671	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.843.461,34	5,09%	271	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.417.194,58	1,57%	387	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	861.614,24	0,56%	701	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.530.438,61	5,53%	686	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	2.290,83	0,00%	11	1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.378.070,77	0,89%	92	0,28%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.241.858,50	0,81%	173	0,21%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.571.816,98	2,32%	34.973	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

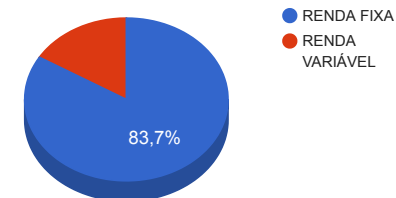
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	157.481,68	0,10%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.106.188,95	2,01%	169	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.640.844,58	4,31%	151	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.257.601,01	1,46%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	500.163,79	0,32%	36	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.791.167,37	1,81%	729	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.893.860,36	1,23%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	757.557,66	0,49%		5,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	872.570,70	0,57%	7	8,35%	Desenquadrado - RV
Total			154.161.927,02				

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

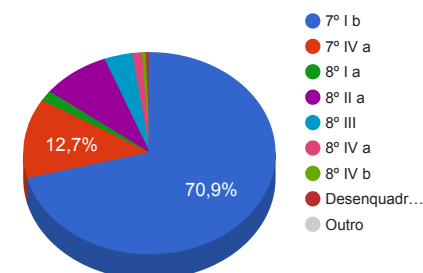
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	109.337.745,07	70,92%	0,00%	64,12%	100,00%	44.824.181,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	19.652.708,77	12,75%	0,00%	22,99%	40,00%	42.012.062,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.290,83	0,00%	0,00%	0,01%	5,00%	7.705.805,52
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.619.929,27	1,70%	0,00%	2,22%	15,00%	20.504.359,78
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	13.476.332,19	8,74%	0,00%	4,01%	15,00%	9.647.956,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.548.932,17	3,60%	0,00%	4,55%	10,00%	9.867.260,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.893.860,36	1,23%	0,00%	1,50%	5,00%	5.814.235,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	757.557,66	0,49%	0,00%	0,60%	5,00%	6.950.538,69
Desenquadrado - RV	0,00%	872.570,70	0,57%	0,00%	0,00%	0,00%	-872.570,70
Total Carteira		154.161.927,02					

RENDA FIXA	128.992.744,67	83,67%
RENDA VARIÁVEL	25.169.182,35	16,33%

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 "	109.337.745,07	70,92%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	19.652.708,77	12,75%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.290,83	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 "	2.619.929,27	1,70%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	13.476.332,19	8,74%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.548.932,17	3,60%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.893.860,36	1,23%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	757.557,66	0,49%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	872.570,70	0,57%	0,00%	0,00%
Total	154.161.927,02	100,00%	0,00	365,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.605.413,60	42,56%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	60.036.250,20	38,94%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	14.484.305,92	9,40%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	8.530.438,61	5,53%	0,00%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.893.860,36	1,23%	8,83%
BANCO J. SAFRA S/A	1.321.593,67	0,86%	0,00%
ROMA ASSET	872.570,70	0,57%	0,72%
Graphen Investimentos	757.557,66	0,49%	0,46%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	500.163,79	0,32%	0,00%
BRASIL PLURAL	2.290,83	0,00%	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 '1095' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rf.asp, line 62