

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.735.826,15	23,55%	270	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	828.373,69	2,00%	915	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	657.925,97	1,59%	73	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	9.424.055,98	22,80%	115	1,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	664.055,50	1,61%	351	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.887.785,44	6,99%	1.390	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.611.560,23	3,90%	940	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.115.009,47	2,70%	362	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	261.528,68	0,63%	26	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.157.777,22	12,48%	110	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	851.182,51	2,06%	31	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	272.384,07	0,66%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.236.453,04	2,99%	33	0,62%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	1.221.267,93	2,95%	184	2,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.445.053,80	3,50%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.968.707,76	9,60%	8	13,84%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			41.338.947,44				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.845.298,51	Artigo 6º			
PL Total			43.184.245,95				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	25.809.582,96	62,43%	0,00%	0,00%	0,00%	-25.809.582,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	7.385.497,88	17,87%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.385.497,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.508.837,11	3,65%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.508.837,11
Desenquadrado - RF	0,00%	5.413.761,56	13,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.413.761,56
Total Renda Fixa	100,00%	40.117.679,51	97,05%	0,00%	0,00%	0,00%	

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	1.221.267,93	2,95%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.221.267,93
Total Renda Variável	30,00%	1.221.267,93	2,95%	0,00%	0,00%	0,00%	

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Agosto / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	25.432.668,82	61,52	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.991.774,86	14,49	0,00
MULTINVEST CAPITAL	5.189.975,69	12,55	2,29
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	2.296.236,31	5,55	0,01
AURORA CAPITAL	1.236.453,04	2,99	0,61
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	657.925,97	1,59	0,01
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	272.384,07	0,66	0,17
RJI CORRETORA DE VALORES	261.528,68	0,63	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,10%	7,06%	2,25%	5,13%	11,98%	20,25%	0,01%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,70%	7,27%	2,05%	5,27%	10,58%	23,22%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	2,60%	0,98%	1,71%	4,66%	1,32%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-5,63%	-11,25%	-4,67%	-6,38%	-5,14%	-24,90%	0,19%	0,13%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,77%	22,00%	5,82%	13,81%	38,20%	41,83%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,79%	21,65%	5,75%	13,61%	37,45%	40,76%	0,04%	0,12%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	4,50%	1,81%	3,45%	7,24%	14,42%	0,00%	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	4,45%	1,79%	3,41%	7,17%	14,26%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	8,22%	2,70%	6,03%	14,23%	21,57%	0,01%	0,03%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,44%	1,80%	3,21%	1,55%	4,11%	-17,07%	0,01%	0,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,01%	8,23%	2,71%	6,03%	14,32%	21,44%	0,01%	0,03%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,48%	7,08%	1,65%	4,92%	7,31%	12,67%	0,02%	0,07%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,39%	8,27%	2,77%	5,15%	7,01%	14,55%	0,01%	0,04%

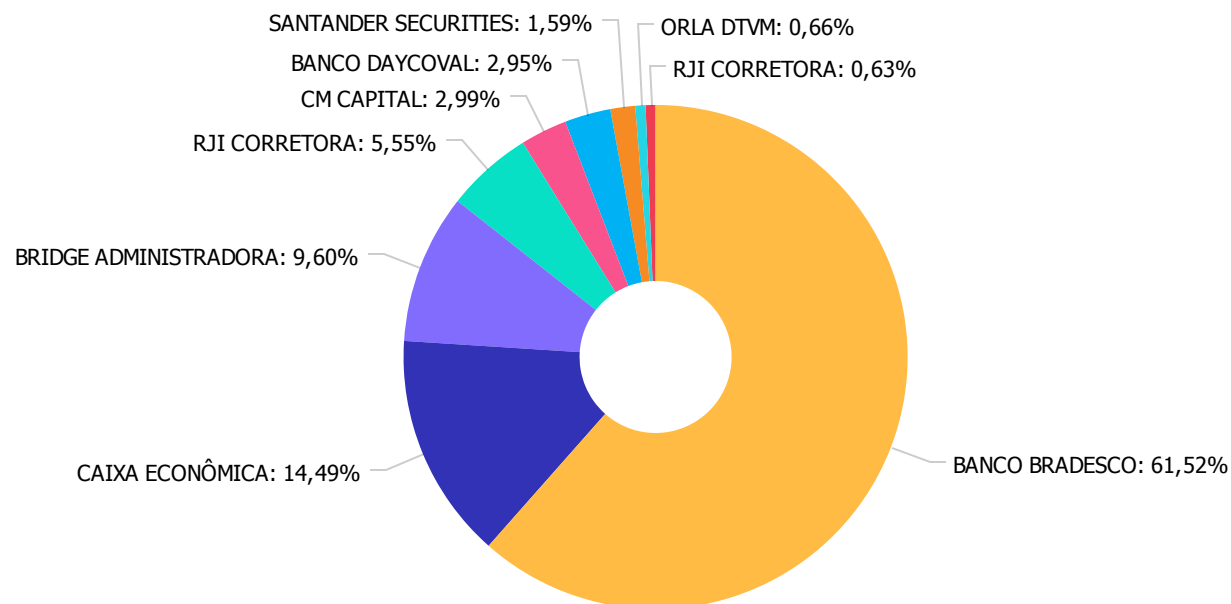
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,37%	2,27%	0,68%	0,72%	2,10%	-6,75%	0,01%	0,05%
IMA-B (Benchmark)	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,35%	14,56%	4,31%	9,92%	23,97%	29,64%	0,02%	0,06%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,43%	15,95%	4,56%	10,55%	27,06%	32,43%	0,02%	0,08%
Selic (Benchmark)	0,50%	4,18%	1,54%	3,11%	6,28%	13,55%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,49%	4,06%	1,50%	3,02%	6,10%	13,17%	0,00%	0,00%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA VARIÁVEL

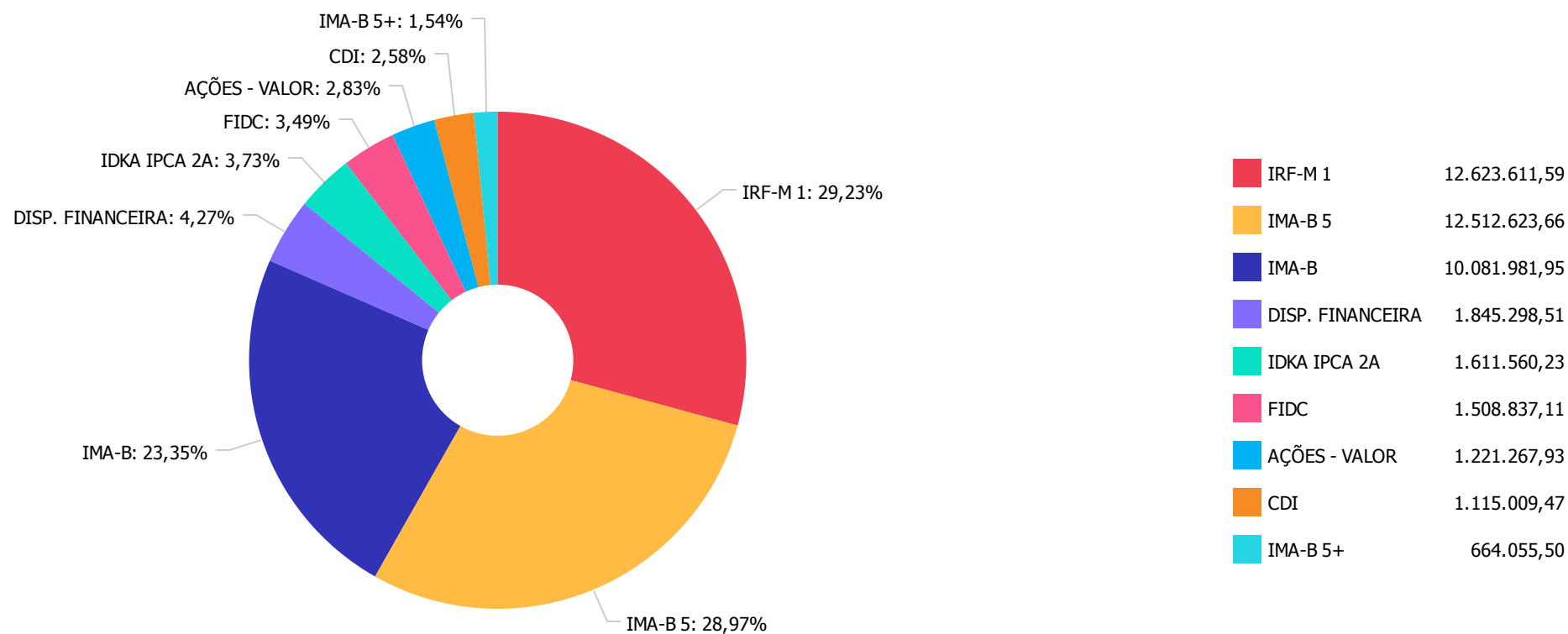
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-
MULTINVEST FIAÇÕES	-2,54%	14,42%	4,81%	3,89%	37,17%	48,24%	0,13%	0,20%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2019)



BANCO BRADESCO	25.432.668,82
CAIXA ECONÔMICA	5.991.774,86
BRIDGE ADMINISTRADORA	3.968.707,76
RJI CORRETORA	2.296.236,31
CM CAPITAL	1.236.453,04
BANCO DAYCOVAL	1.221.267,93
SANTANDER SECURITIES	657.925,97
ORLA DTVM	272.384,07
RJI CORRETORA	261.528,68

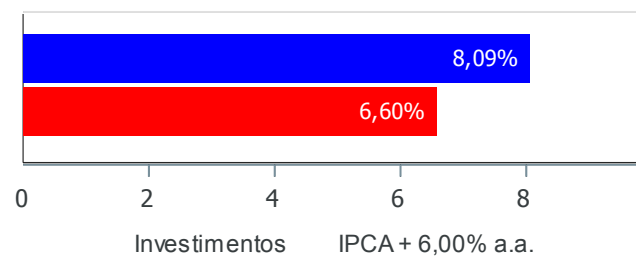
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

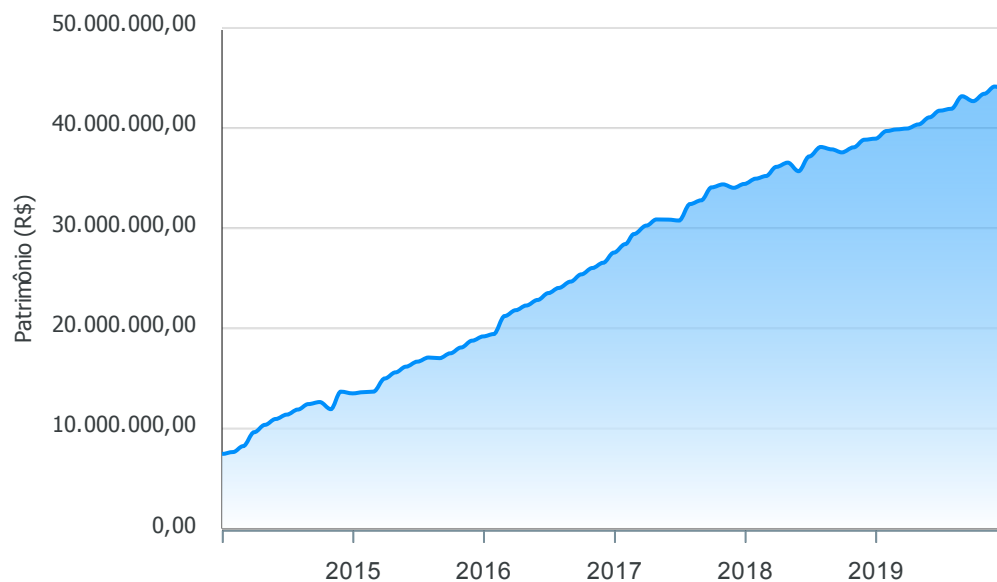
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	37.196.288,02	0,00	30.385,41	37.929.799,76	763.897,15	763.897,15	2,05%	2,05%	0,83%	0,83%	246,95%	1,34%
Fevereiro	37.929.799,76	1.100.000,00	0,00	39.188.402,17	158.602,41	922.499,56	0,41%	2,47%	0,90%	1,73%	142,30%	1,86%
Março	39.188.402,17	0,00	0,00	39.302.048,68	113.646,51	1.036.146,07	0,29%	2,77%	1,19%	2,95%	93,78%	2,19%
Abril	39.302.048,68	0,00	0,00	39.654.907,79	352.859,11	1.389.005,18	0,90%	3,69%	1,06%	4,04%	91,30%	0,93%
Maio	39.654.907,79	0,00	0,00	40.299.510,93	644.603,14	2.033.608,32	1,63%	5,37%	0,64%	4,71%	114,18%	1,23%
Junho	40.299.510,93	0,00	0,00	41.040.308,81	740.797,88	2.774.406,20	1,84%	7,31%	0,45%	5,18%	141,19%	1,44%
Julho	41.040.308,81	0,00	0,00	41.415.295,93	374.987,12	3.149.393,32	0,91%	8,29%	0,72%	5,94%	139,59%	0,98%
Agosto	41.415.295,93	0,00	0,00	41.338.947,44	-76.348,49	3.073.044,83	-0,18%	8,09%	0,62%	6,60%	122,66%	2,07%

Investimentos x Meta Atuarial



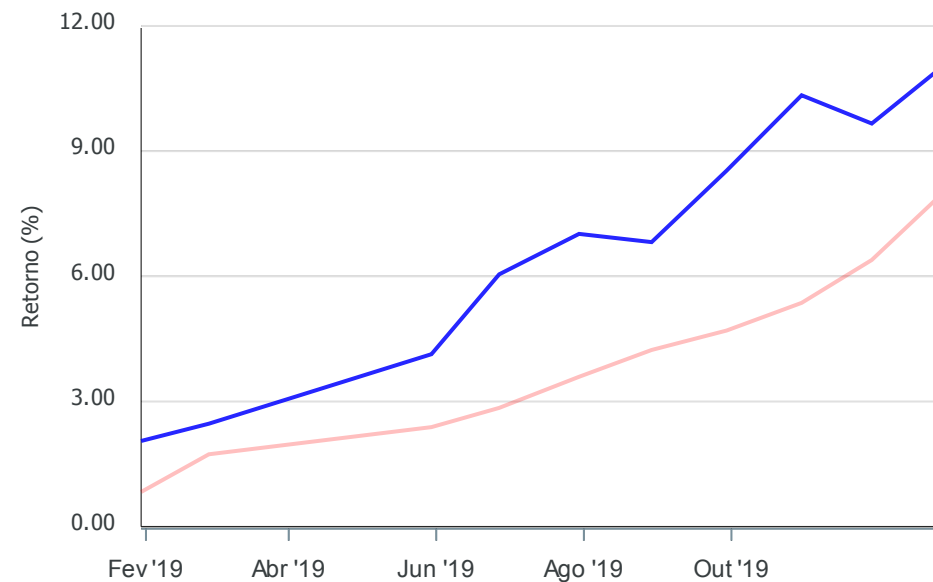
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta Atuarial ☐ CDI ☐ IMA-B ☐ IMA-B 5
☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1 ☐ IRF-M 1+
☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.872.704,73	0,00	0,00	2.887.785,44	15.080,71	0,52%	0,52%	0,18%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.684.997,61	0,00	0,00	9.735.826,15	50.828,54	0,52%	0,52%	0,18%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.109.587,83	0,00	0,00	1.115.009,47	5.421,64	0,49%	0,49%	0,00%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.953.417,62	0,00	0,00	3.968.707,76	15.290,14	0,39%	0,39%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.609.949,81	0,00	0,00	1.611.560,23	1.610,42	0,10%	0,10%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	828.084,56	0,00	0,00	828.373,69	289,13	0,03%	0,03%	1,04%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	272.305,68	0,00	0,00	272.384,07	78,39	0,03%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.157.262,28	0,00	0,00	5.157.777,22	514,94	0,01%	0,01%	1,06%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	660.261,26	0,00	0,00	657.925,97	-2.335,29	-0,35%	-0,35%	2,34%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	262.496,49	0,00	0,00	261.528,68	-967,81	-0,37%	-0,37%	1,22%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	9.464.671,49	0,00	0,00	9.424.055,98	-40.615,51	-0,43%	-0,43%	2,46%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	854.960,99	0,00	0,00	851.182,51	-3.778,48	-0,44%	-0,44%	0,94%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.452.038,92	0,00	0,00	1.445.053,80	-6.985,12	-0,48%	-0,48%	1,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	669.326,72	0,00	0,00	664.055,50	-5.271,22	-0,79%	-0,79%	3,61%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.310.184,71	0,00	0,00	1.236.453,04	-73.731,67	-5,63%	-5,63%	19,02%
Total Renda Fixa	40.162.250,70	0,00	0,00	40.117.679,51	-44.571,19	-0,11%		1,74%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MULTINVEST FIAÇÕES	1.253.045,23	0,00	0,00	1.221.267,93	-31.777,30	-2,54%	-2,54%	12,79%
Total Renda Variável	1.253.045,23	0,00	0,00	1.221.267,93	-31.777,30	-2,54%		12,79%