

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 2019)

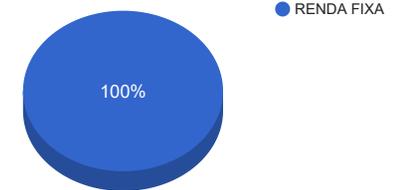
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.965.993,03	17,10%	873	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.252.954,81	22,65%	295	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.184.536,67	18,04%	1.250	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.342.024,35	10,10%	507	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	532.799,31	2,30%	1.419	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.024.351,22	8,73%	110	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	567.000,92	2,44%	159	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.992.259,45	12,90%	560	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	8.845,64	0,04%	953	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.233.847,76	5,32%	744	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
Total para cálculo dos limites da Resolução			23.104.613,16				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			91.005,38				Artigo 6º
Total			23.195.618,54				

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

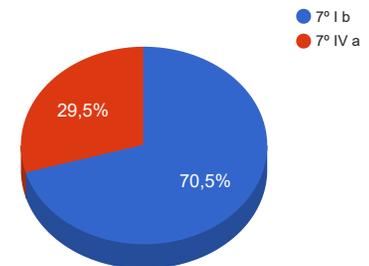
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	16.278.308,17	70,45%	15,00%	25,00%	70,00%	-105.078,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	13.862.767,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.826.304,99	29,55%	10,00%	30,00%	40,00%	2.415.540,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.155.230,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	4.620.922,63
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	2.310.461,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.155.230,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.155.230,66
Total Carteira		23.104.613,16					

RENDA FIXA	23.195.618,54	100,39%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	16.278.308,17	70,18%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.826.304,99	29,43%	10,00%	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 II, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	23.104.613,16	99,61%	43,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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)

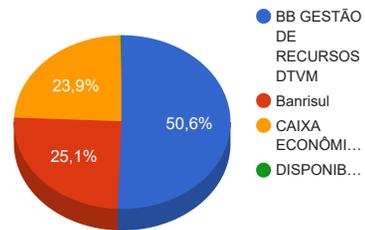
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.726.401,81	50,55%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	5.828.801,37	25,13%	0,05%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.549.409,98	23,92%	0,00%

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

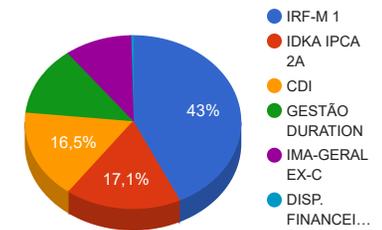
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral ex-C	1,95%	7,74%	4,69%	7,74%	15,64%	25,19%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	8,23%	5,14%	8,23%	15,98%	25,74%	0,30%	1,213%	3,59%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,76%	3,19%	5,76%	11,97%	22,82%	0,20%	0,911%	1,98%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,23%	1,74%	3,23%	7,09%	15,23%	0,20%	0,148%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,10%	0,171%	0,49%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,57%	3,24%	1,72%	3,24%	7,03%	15,16%	0,20%	0,153%	0,45%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	3,01%	1,50%	3,01%	6,19%	14,07%	0,20%	0,003%	0,11%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,46%	2,99%	1,49%	2,99%	6,14%	13,78%	0,15%	0,002%	0,12%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,73%	10,92%	6,70%	10,92%	16,74%	26,22%	0,002	1,653%	3,42%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,48%	3,04%	1,57%	3,04%	6,22%	13,78%	0,20%	0,040%	0,13%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,43%	2,80%	1,40%	2,80%	5,76%	12,97%	0,50%	0,001%	0,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.726.401,81	50,55%
Banrisul	5.828.801,37	25,13%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.549.409,98	23,92%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	91.005,38	0,39%



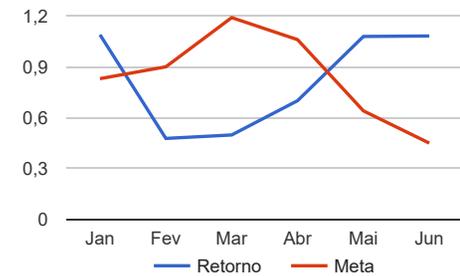
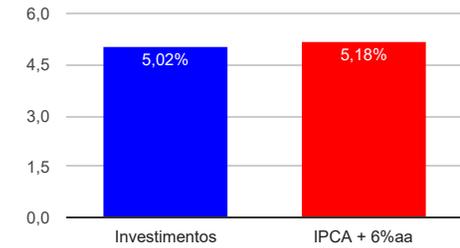
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.970.290,79	42,98%
IDKA IPCA 2A	3.965.993,03	17,10%
CDI	3.834.045,54	16,53%
GESTÃO DURATION	2.992.259,45	12,90%
IMA-GERAL EX-C	2.342.024,35	10,10%
DISP. FINANCEIRA	91.005,38	0,39%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	21.848.017,85	0,00	84.000,00	22.001.909,46	237.891,61	1,09%	0,83%	130,93%	0,40%
Fevereiro	22.001.909,46	0,00	0,00	22.106.971,64	105.062,18	0,48%	0,90%	53,32%	0,56%
Março	22.106.971,64	0,00	80.000,00	22.137.064,85	110.093,21	0,50%	1,19%	41,72%	0,88%
Abril	22.137.064,85	400.000,00	75.000,00	22.619.315,76	157.250,91	0,70%	1,06%	66,07%	0,40%
Mai	22.619.315,76	0,00	0,00	22.863.333,34	244.017,58	1,08%	0,64%	168,39%	0,55%
Junho	22.863.333,34	0,00	6.000,00	23.104.613,16	247.279,82	1,08%	0,45%	240,16%	0,57%
Acumulado no ano					1.101.595,31	5,02%	5,18%	97,04%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.912.605,48	0,00	0,00	2.992.259,45	79.653,97	2,73%	1,65%	2,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.292.277,32	0,00	0,00	2.342.024,35	49.747,03	2,17%	1,21%	2,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.922.629,51	0,00	0,00	3.965.993,03	43.363,52	1,11%	0,91%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	529.761,35	0,00	0,00	532.799,31	3.037,96	0,57%	0,15%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.160.715,75	0,00	0,00	4.184.536,67	23.820,92	0,57%	0,17%	0,57%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.223.189,89	0,00	0,00	5.252.954,81	29.764,92	0,57%	0,15%	0,57%
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.014.689,53	0,00	0,00	2.024.351,22	9.661,69	0,48%	0,04%	0,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.234.225,81	0,00	6.000,00	1.233.847,76	5.621,95	0,46%	0,00%	0,46%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	564.430,73	0,00	0,00	567.000,92	2.570,19	0,46%	0,00%	0,46%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	8.807,97	0,00	0,00	8.845,64	37,67	0,43%	0,00%	0,43%
				Total Renda Fixa	247.279,82	1,08%	0,57%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.734.908,10	70.000,00	0,00	2.992.259,45	187.351,35	6,68%	6,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.516.542,68	330.000,00	0,00	3.965.993,03	119.450,35	3,11%	3,19%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.227.564,88	0,00	0,00	2.342.024,35	114.459,47	5,14%	5,14%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.164.213,42	0,00	0,00	5.252.954,81	88.741,39	1,72%	1,72%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.113.519,43	0,00	0,00	4.184.536,67	71.017,24	1,73%	1,73%
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.993.075,79	0,00	0,00	2.024.351,22	31.275,43	1,57%	1,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.221.527,65	0,00	6.000,00	1.233.847,76	18.320,11	1,50%	1,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	523.692,19	0,00	0,00	532.799,31	9.107,12	1,74%	1,74%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	633.297,44	0,00	75.000,00	567.000,92	8.703,48	1,49%	1,49%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	8.723,27	0,00	0,00	8.845,64	122,37	1,40%	1,40%
Total Renda Fixa					648.548,31	2,89%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.630.737,65	70.000,00	0,00	2.992.259,45	291.521,80	10,90%	10,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.431.044,66	330.000,00	0,00	3.965.993,03	204.948,37	5,67%	5,76%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.164.016,71	0,00	0,00	2.342.024,35	178.007,64	8,23%	8,23%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.088.286,67	0,00	0,00	5.252.954,81	164.668,14	3,24%	3,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.054.344,52	0,00	0,00	4.184.536,67	130.192,15	3,21%	3,21%
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.964.535,99	0,00	0,00	2.024.351,22	59.815,23	3,04%	3,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.203.675,58	0,00	6.000,00	1.233.847,76	36.172,18	3,01%	3,01%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	776.931,34	0,00	229.000,00	567.000,92	19.069,58	2,93%	2,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	516.123,13	0,00	0,00	532.799,31	16.676,18	3,23%	3,23%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	18.321,60	0,00	10.000,00	8.845,64	524,04	4,11%	2,80%
Total Renda Fixa					1.101.595,31	5,02%	