

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			38.370,00	0,11%			Artigo 20
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.312.626,60	9,27%	442	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	899.600,28	2,52%	93	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.794.992,72	21,81%	233	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	759.224,66	2,12%	140	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	273.049,37	0,76%	93	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.546.731,48	12,72%	391	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	677.325,00	1,90%	96	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	571.077,15	1,60%	18	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	379.459,37	1,06%	107	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	D+0	Não há	3.852.368,54	10,78%	93	1,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	434.239,53	1,21%	25	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.379.198,19	12,25%	219	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.773.543,44	7,76%	832	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	129.927,12	0,36%	953	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	61.298,14	0,17%	47.986	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	644.666,38	1,80%	118	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	64.654,37	0,18%	2.685	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	948.324,18	2,65%	12	7,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	39.212,92	0,11%	727	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	175.951,87	0,49%	55	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	128.861,09	0,36%	33	0,13%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

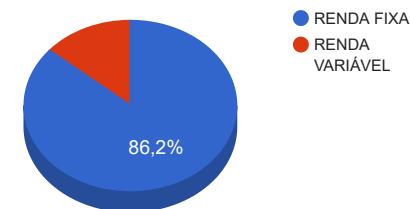
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	545.539,50	1,53%	729	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.632.077,23	4,57%	955	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	108.892,42	0,30%		0,07%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	119.300,00	0,33%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se aplica	Não se aplica	449.695,50	1,26%		0,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>35.740.207,05</b>				

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

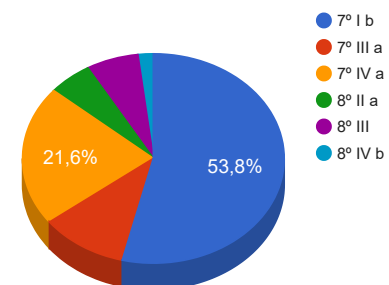
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	19.214.086,63	53,76%	25,00%	40,00%	70,00%	5.804.058,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	3.852.368,54	10,78%	5,00%	10,00%	60,00%	17.591.755,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.716.908,28	21,59%	10,00%	20,00%	40,00%	6.579.174,54
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.934.107,86	5,41%	5,00%	10,00%	20,00%	5.213.933,55
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.306.477,82	6,45%	5,00%	10,00%	10,00%	1.267.542,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.787.010,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	677.887,92	1,90%	0,00%	5,00%	5,00%	1.109.122,43
Total Carteira		35.701.837,05					

RENDA FIXA	30.821.733,45	86,33%
RENDA VARIÁVEL	4.918.473,60	13,78%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	19.214.086,63	53,76%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	3.852.368,54	10,78%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.716.908,28	21,59%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.934.107,86	5,41%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.306.477,82	6,45%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	677.887,92	1,90%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>35.701.837,05</b>	<b>99,89%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 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	13.805.581,83	38,63%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.873.927,66	30,42%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	9.245.565,06	25,87%	0,08%
VINCI PARTNERS	644.666,38	1,80%	0,00%
AUSTRO CAPITAL	563.100,62	1,58%	0,13%
OLIVEIRA TRUST	449.695,50	1,26%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	119.300,00	0,33%	0,01%

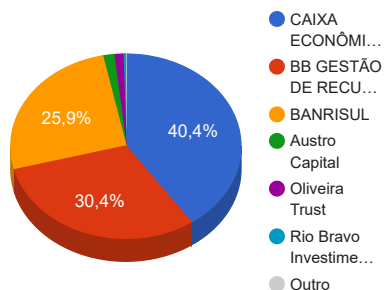
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (março / 2019)

---

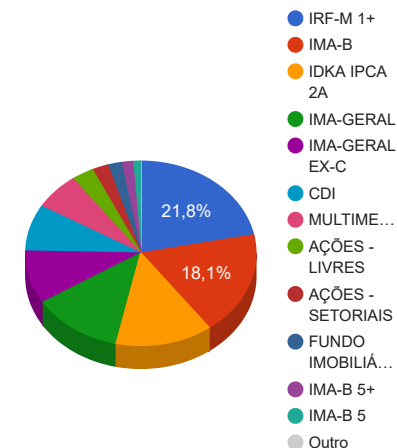
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (março / 2019) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	14.450.248,21	40,43%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.873.927,66	30,42%
BANRISUL	9.245.565,06	25,87%
Austro Capital	563.100,62	1,58%
Oliveira Trust	449.695,50	1,26%
Rio Bravo Investimentos	119.300,00	0,33%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	38.370,00	0,11%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1+	7.794.992,72	21,81%
IMA-B	6.472.262,66	18,11%
IDKA IPCA 2A	4.819.780,85	13,49%
IMA-GERAL	4.529.693,54	12,67%
IMA-GERAL EX-C	3.312.626,60	9,27%
CDI	2.903.470,56	8,12%
MULTIMERCADO	2.306.477,82	6,45%
AÇÕES - LIVRES	1.124.276,05	3,15%
AÇÕES - SETORIAIS	809.831,81	2,27%
FUNDO IMOBILIÁRIO	677.887,92	1,90%
IMA-B 5+	571.077,15	1,60%
IMA-B 5	379.459,37	1,06%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	38.370,00	0,11%

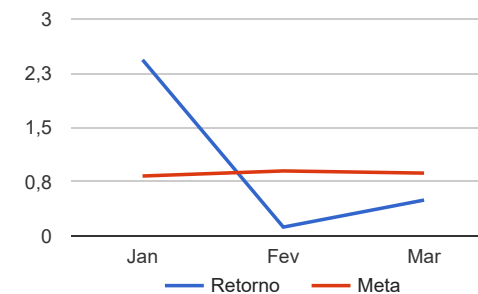
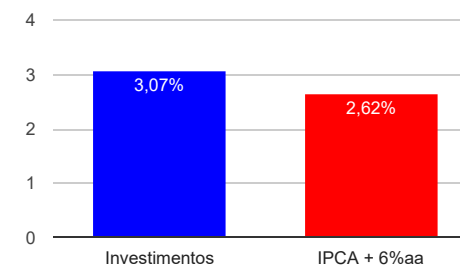




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	34.700.185,49	848.368,99	734.139,51	35.661.603,12	847.188,15	2,43%	0,83%	292,61%	1,59%
Fevereiro	35.661.603,12	451.811,19	797.235,62	35.360.716,13	44.537,44	0,12%	0,90%	13,95%	1,96%
Março	35.360.716,13	848.362,29	684.157,45	35.701.837,05	176.916,08	0,50%	0,87%	57,10%	2,41%
Acumulado no ano					1.068.641,67	3,07%	2,62%	117,17%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	670.615,00	0,00	0,00	677.325,00	6.710,00	1,00%	0,14%	1,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	892.628,30	0,00	0,00	899.600,28	6.971,98	0,78%	1,70%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	753.660,15	0,00	0,00	759.224,66	5.564,51	0,74%	1,41%	0,74%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	4.516.270,44	0,00	0,00	4.546.731,48	30.461,04	0,67%	0,95%	0,67%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	377.240,73	0,00	0,00	379.459,37	2.218,64	0,59%	0,50%	0,59%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	567.746,20	0,00	0,00	571.077,15	3.330,95	0,59%	4,09%	0,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.552.580,14	197.202,70	0,00	7.794.992,72	45.209,88	0,58%	2,27%	0,59%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.289.248,00	66.911,31	0,00	4.379.198,19	23.038,88	0,53%	4,04%	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.295.516,66	0,00	0,00	3.312.626,60	17.109,94	0,52%	1,95%	0,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.760.668,54	0,00	0,00	2.773.543,44	12.874,90	0,47%	0,01%	0,47%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	3.731.679,73	410.000,00	308.100,00	3.852.368,54	18.788,81	0,45%	1,57%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	271.830,99	0,00	0,00	273.049,37	1.218,38	0,45%	0,00%	0,45%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	132.788,90	1.423,22	4.850,00	129.927,12	565,00	0,42%	0,00%	0,43%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	27.005,92	172.825,06	199.937,37	0,00	106,39	0,05%	0,00%	0,41%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	434.180,31	0,00	0,00	434.239,53	59,22	0,01%	0,95%	0,01%
Total Renda Fixa					174.228,52	0,57%	1,88%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PETROBRAS FI AÇÕES	58.982,65	0,00	0,00	61.298,14	2.315,49	3,93%	19,25%	3,93%
GERAÇÃO FI AÇÕES	166.906,58	0,00	171.270,08	0,00	4.363,50	2,61%	10,13%	0,30%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	439.433,50	0,00	0,00	449.695,50	10.262,00	2,34%	7,53%	2,57%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	116.900,00	0,00	0,00	119.300,00	2.400,00	2,05%	5,21%	2,05%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	107.418,24	0,00	0,00	108.892,42	1.474,18	1,37%	6,35%	-1,08%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	175.270,98	0,00	0,00	175.951,87	680,89	0,39%	12,47%	0,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.625.991,33	0,00	0,00	1.632.077,23	6.085,90	0,37%	0,94%	0,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	543.778,00	0,00	0,00	545.539,50	1.761,50	0,32%	0,27%	0,32%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	39.150,46	0,00	0,00	39.212,92	62,46	0,16%	9,75%	0,16%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	129.016,62	0,00	0,00	128.861,09	-155,53	-0,12%	0,03%	-0,12%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	649.197,67	0,00	0,00	644.666,38	-4.531,29	-0,70%	10,19%	-0,70%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	65.215,98	0,00	0,00	64.654,37	-561,61	-0,86%	12,20%	-0,86%
BB PIPE FIC AÇÕES	969.794,11	0,00	0,00	948.324,18	-21.469,93	-2,21%	11,33%	-2,21%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.687,56</b>	<b>0,05%</b>	<b>5,74%</b>	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.078.476,70	78.051,09	0,00	4.379.198,19	222.670,40	5,44%	5,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.585.886,16	1.032.524,44	0,00	7.794.992,72	176.582,12	2,46%	2,48%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	4.435.148,18	0,00	0,00	4.546.731,48	111.583,30	2,52%	2,52%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	4.243.498,21	410.000,00	910.158,15	3.852.368,54	109.028,48	2,62%	2,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.218.123,69	0,00	0,00	3.312.626,60	94.502,91	2,94%	2,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.732.940,55	0,00	0,00	2.773.543,44	40.602,89	1,49%	1,49%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	550.649,75	0,00	14.189,63	571.077,15	34.617,03	6,30%	3,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	895.171,45	0,00	23.415,96	899.600,28	27.844,79	3,13%	3,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	757.627,13	0,00	20.451,79	759.224,66	22.049,32	2,93%	2,93%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	679.770,00	0,00	20.133,90	677.325,00	17.688,90	2,63%	-0,36%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	381.545,35	0,00	10.358,75	379.459,37	8.272,77	2,18%	-0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	269.157,08	0,00	0,00	273.049,37	3.892,29	1,45%	1,45%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	431.708,14	0,00	0,00	434.239,53	2.531,39	0,59%	0,59%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	127.703,50	5.288,26	4.850,00	129.927,12	1.785,36	1,37%	1,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	416.975,41	622.678,68	1.040.704,32	0,00	1.050,23	0,22%	1,31%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>874.702,18</b>	<b>2,92%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	576.194,46	0,00	0,00	644.666,38	68.471,92	11,88%	11,88%
BB PIPE FIC AÇÕES	900.328,37	0,00	0,00	948.324,18	47.995,81	5,33%	5,33%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.606.794,87	0,00	0,00	1.632.077,23	25.282,36	1,57%	1,57%
GERAÇÃO FI AÇÕES	153.064,35	0,00	171.270,08	0,00	18.205,73	11,89%	9,37%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	162.913,84	0,00	0,00	175.951,87	13.038,03	8,00%	8,00%
BB PETROBRAS FI AÇÕES	50.197,14	0,00	0,00	61.298,14	11.101,00	22,11%	22,11%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	539.266,00	0,00	0,00	545.539,50	6.273,50	1,16%	1,16%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	60.816,62	0,00	0,00	64.654,37	3.837,75	6,31%	6,31%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	35.990,10	0,00	0,00	39.212,92	3.222,82	8,95%	8,95%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	105.819,72	0,00	0,00	108.892,42	3.072,70	2,90%	1,25%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	119.999,00	0,00	0,00	119.300,00	-699,00	-0,58%	-0,58%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	129.813,12	0,00	0,00	128.861,09	-952,03	-0,73%	-0,73%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	454.606,60	0,00	0,00	449.695,50	-4.911,10	-1,08%	-0,53%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>193.939,49</b>	<b>3,96%</b>	