

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

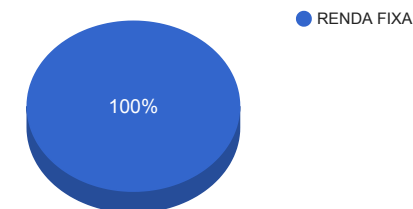
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	1.333.020,00	4,69%	96	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	923.863,75	3,25%	711	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.417.215,28	4,99%	661	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.824.580,14	16,98%	638	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	383.799,90	1,35%	17	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.953.767,46	13,91%	1.438	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.135.784,00	7,52%	104	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.121.620,93	3,95%	179	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.891.714,10	10,18%	221	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	D+0	Não há	2.023.832,46	7,12%	95	1,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	D+0	Não há	1.439.689,77	5,07%	75	0,94%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.120.800,59	18,02%	761	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	845.157,80	2,97%	965	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>TOTAL -</b>			<b>28.414.846,18</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (junho / 2018)

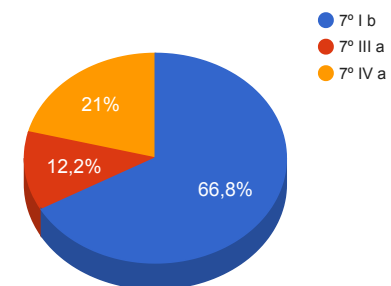
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	18.985.365,56	66,81%	0,00%	51,00%	100,00%	9.429.480,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	3.463.522,23	12,19%	0,00%	21,00%	60,00%	13.585.385,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	5.965.958,39	21,00%	0,00%	28,00%	40,00%	5.399.980,08
Total Carteira		28.414.846,18					

RENDA FIXA	28.414.846,18	100,00%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	18.985.365,56	66,81%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	3.463.522,23	12,19%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	5.965.958,39	21,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
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 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>28.414.846,18</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>315,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 2018)

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	17.652.345,56	62,12%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	5.641.700,03	19,85%	0,06%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.120.800,59	18,02%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2018)

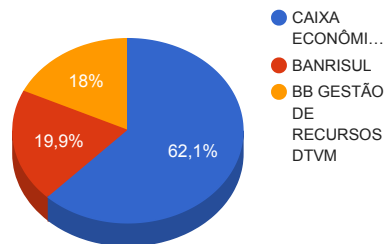
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,39%	2,43%	2,81%	2,43%	3,95%	7,94%	0,15%	0,260%	3,99%
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,95%	1,18%	2,95%	7,60%	21,87%	0,20%	0,685%	0,50%
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,42%	2,68%	-0,77%	2,68%	9,48%	22,32%	0,20%	3,126%	2,66%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	2,98%	-0,03%	2,98%	9,98%	24,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21%	3,27%	0,20%	3,27%	9,73%	23,00%	0,20%	2,643%	2,13%
IMA Geral	0,12%	2,44%	-0,99%	2,44%	8,47%	23,90%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,16%	2,40%	-0,98%	2,40%	8,31%	23,81%	0,20%	2,028%	2,24%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL...	0,13%	2,35%	-0,98%	2,35%	8,23%	23,93%	0,20%	2,037%	2,22%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,07%	2,17%	-1,16%	2,17%	7,96%	23,54%	0,20%	2,212%	2,35%
IMA-B	-0,32%	1,16%	-3,61%	1,16%	8,20%	22,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	-0,56%	-3,60%	-0,56%	3,40%	10,93%	0,20%	5,120%	5,88%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	-0,56%	-3,61%	-0,56%	3,38%	10,92%	0,20%	5,120%	5,88%

## Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2018)

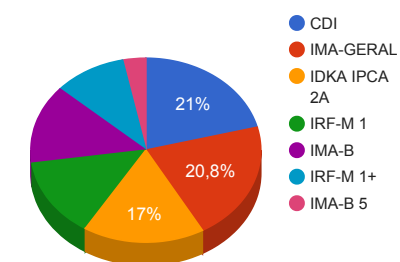
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,36%	1,03%	-3,68%	1,03%	7,92%	22,14%	0,20%	3,952%	4,56%
IRF-M 1+	-0,15%	2,07%	-2,32%	2,07%	9,28%	29,10%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,15%	2,00%	-2,56%	2,00%	8,88%	28,46%	0,20%	3,891%	3,78%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,47%	2,88%	1,41%	2,88%	6,81%	19,96%	0,50%	0,004%	0,07%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.652.345,56	62,12%
BANRISUL	5.641.700,03	19,85%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.120.800,59	18,02%



Sub-segmento	Valor	%
CDI	5.965.958,39	21,00%
IMA-GERAL	5.918.163,16	20,83%
IDKA IPCA 2A	4.824.580,14	16,98%
IRF-M 1	3.953.767,46	13,91%
IMA-B	3.936.799,18	13,85%
IRF-M 1+	2.891.714,10	10,18%
IMA-B 5	923.863,75	3,25%

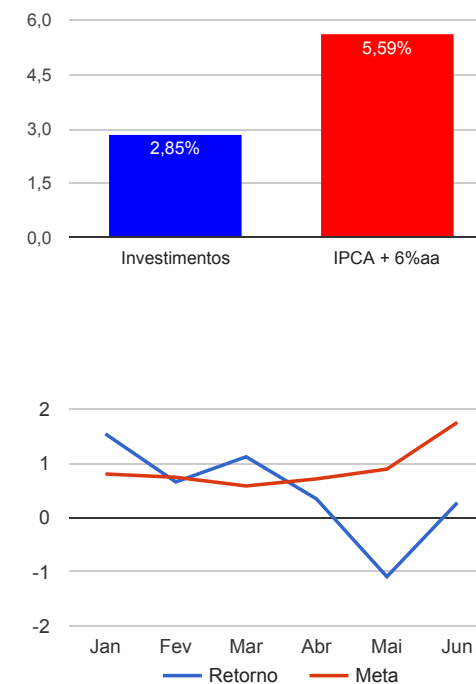




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	27.542.174,73	42.350,15	98.268,30	27.910.085,99	423.829,41	1,54%	0,80%	192,00%	0,74%
Fevereiro	27.910.085,99	246.595,93	214.097,47	28.125.318,66	182.734,21	0,65%	0,74%	88,56%	1,24%
Março	28.125.318,66	136.927,76	105.530,60	28.471.191,33	314.475,51	1,12%	0,58%	193,50%	0,74%
Abril	28.471.191,33	140.483,35	111.121,44	28.597.801,90	97.248,66	0,34%	0,71%	48,21%	0,59%
Mai	28.597.801,90	3.275.340,30	3.247.408,44	28.313.778,59	-311.955,17	-1,09%	0,89%	-122,63%	1,07%
Junho	28.313.778,59	140.291,30	116.066,44	28.414.846,18	76.842,73	0,27%	1,75%	15,47%	2,04%
Acumulado no ano					783.175,35	2,85%	5,59%	50,91%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.314.740,00	0,00	0,00	1.333.020,00	18.280,00	1,39%	0,26%	1,39%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.095.270,58	0,00	0,00	5.120.800,59	25.530,01	0,50%	0,02%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.834.566,81	99.680,67	0,00	3.953.767,46	19.519,98	0,50%	0,68%	0,50%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	800.783,84	40.610,63	0,00	845.157,80	3.763,33	0,45%	0,00%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	919.992,97	0,00	0,00	923.863,75	3.870,78	0,42%	3,13%	0,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.814.567,45	0,00	0,00	4.824.580,14	10.012,69	0,21%	2,64%	0,21%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	1.545.608,29	0,00	108.000,00	1.439.689,77	2.081,48	0,13%	2,03%	0,16%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	2.021.241,22	0,00	0,00	2.023.832,46	2.591,24	0,13%	2,04%	0,13%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.128.876,41	0,00	8.066,44	1.121.620,93	810,96	0,07%	2,21%	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.135.941,50	0,00	0,00	2.135.784,00	-157,50	-0,01%	5,12%	-0,01%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	383.829,60	0,00	0,00	383.799,90	-29,70	-0,01%	5,12%	-0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.896.025,69	0,00	0,00	2.891.714,10	-4.311,59	-0,15%	3,89%	-0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.422.334,23	0,00	0,00	1.417.215,28	-5.118,95	-0,36%	3,95%	-0,36%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>76.842,73</b>	<b>0,27%</b>	<b>2,04%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.043.431,48	0,00	0,00	5.120.800,59	77.369,11	1,53%	1,53%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.296.640,00	0,00	0,00	1.333.020,00	36.380,00	2,81%	2,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	655.068,34	3.273.504,88	0,00	3.953.767,46	25.194,24	1,05%	1,18%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	561.899,99	272.970,03	0,00	845.157,80	10.287,78	1,32%	1,41%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.815.109,93	0,00	0,00	4.824.580,14	9.470,21	0,20%	0,20%
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.213.402,75	8.782,40	1.230.694,58	0,00	8.509,43	0,70%	1,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	931.055,68	0,00	0,00	923.863,75	-7.191,93	-0,77%	-0,77%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.151.404,18	857,64	17.313,82	1.121.620,93	-13.327,07	-1,16%	-1,16%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	398.157,60	0,00	0,00	383.799,90	-14.357,70	-3,61%	-3,61%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	1.780.455,37	0,00	324.000,00	1.439.689,77	-16.765,60	-1,01%	-0,98%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	2.043.933,57	0,00	0,00	2.023.832,46	-20.101,11	-0,98%	-0,98%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.926.032,74	0,00	1.902.587,92	0,00	-23.444,82	-1,22%	-3,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.471.353,15	0,00	0,00	1.417.215,28	-54.137,87	-3,68%	-3,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.967.592,05	0,00	0,00	2.891.714,10	-75.877,95	-2,56%	-2,56%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.215.654,50	0,00	0,00	2.135.784,00	-79.870,50	-3,60%	-3,60%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-137.863,78</b>	<b>-0,48%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.964.661,09	0,00	0,00	5.120.800,59	156.139,50	3,15%	3,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.671.938,47	0,00	0,00	4.824.580,14	152.641,67	3,27%	3,27%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.301.350,00	0,00	36.862,30	1.333.020,00	68.532,30	5,37%	2,43%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.836.739,97	0,00	1.902.587,92	0,00	65.847,95	3,59%	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.835.034,47	0,00	0,00	2.891.714,10	56.679,63	2,00%	2,00%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	1.977.390,57	0,00	0,00	2.023.832,46	46.441,89	2,35%	2,35%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	1.815.540,89	0,00	419.237,78	1.439.689,77	43.386,66	2,36%	2,40%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.147.898,00	0,00	55.489,08	2.135.784,00	43.375,08	1,98%	-0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	643.783,41	3.273.504,88	0,00	3.953.767,46	36.479,17	2,82%	2,95%
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.195.606,26	8.782,40	1.230.694,58	0,00	26.305,92	2,20%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.123.827,07	857,64	27.547,22	1.121.620,93	24.483,44	2,17%	2,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	835.223,39	65.451,45	0,00	923.863,75	23.188,91	2,67%	2,68%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	404.398,99	633.392,42	210.111,44	845.157,80	17.477,83	2,61%	2,88%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.402.806,65	0,00	0,00	1.417.215,28	14.408,63	1,03%	1,03%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	385.975,50	0,00	9.962,37	383.799,90	7.786,77	1,98%	-0,56%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>783.175,35</b>	<b>2,85%</b>	