

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

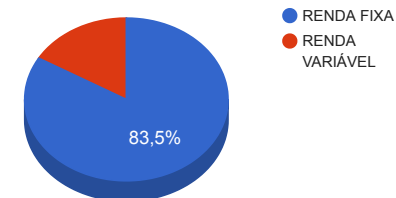
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	D+1	Não há	13.218.243,00	3,37%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.598.270,81	3,97%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	22.158.372,59	5,64%	20	7,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	38.753.552,15	9,87%	377	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	18.015.431,22	4,59%	287	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	12.032.083,46	3,06%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	61.127.432,16	15,56%	303	3,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	76.370.455,56	19,44%	738	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.684.433,94	0,68%	57	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	28.064.489,56	7,15%	793	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.931.957,57	5,33%	419	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.388.409,62	2,64%	26	5,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	8.472.842,16	2,16%	74	1,55%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.639.877,33	1,69%	6.087	0,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou D+18 (isento de taxa de	Não há	3.494.931,90	0,89%	808	1,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	resgate) D+24	Não há	20.845.069,38	5,31%	151	1,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	10.000.771,49	2,55%	46	2,43%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	12.947.813,15	3,30%	8.359	1,53%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.189.124,40	1,07%	102	0,73%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	956.458,22	0,24%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.442.548,97	0,37%		0,75%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.442.604,10	1,13%		0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			392.775.172,74				

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

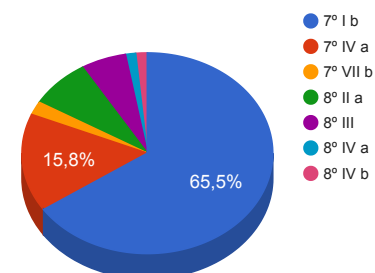
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	257.273.840,95	65,50%	15,00%	35,00%	70,00%	17.668.779,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	15,00%	60,00%	235.665.103,64
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	62.069.290,69	15,80%	5,00%	20,00%	40,00%	95.040.778,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	19.638.758,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	8.472.842,16	2,16%	0,00%	2,50%	5,00%	11.165.916,48
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	30.979.878,61	7,89%	2,00%	12,00%	20,00%	47.575.155,94
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	22.948.584,64	5,84%	2,00%	8,00%	10,00%	16.328.932,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.145.582,62	1,31%	1,00%	2,50%	5,00%	14.493.176,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	5.885.153,07	1,50%	1,00%	2,50%	5,00%	13.753.605,57
Total Carteira		392.775.172,74					

RENDA FIXA	327.815.973,80	83,46%
RENDA VARIÁVEL	64.959.198,94	16,54%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	257.273.840,95	65,50%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	62.069.290,69	15,80%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	8.472.842,16	2,16%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	30.979.878,61	7,89%	2,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	22.948.584,64	5,84%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.145.582,62	1,31%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5.885.153,07	1,50%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa	392.775.172,74	100,00%	31,00	230,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	94.091.473,19	23,96%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	90.889.154,68	23,14%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	77.326.913,78	19,69%	0,02%
WESTERN ASSET	45.106.957,23	11,48%	0,10%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	28.403.840,84	7,23%	0,01%
ITAU UNIBANCO	23.529.503,32	5,99%	0,00%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	13.218.243,00	3,37%	0,02%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.639.877,33	1,69%	0,02%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.442.604,10	1,13%	0,27%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.189.124,40	1,07%	0,02%
Occam Brasil	3.494.931,90	0,89%	0,03%
BRASIL PLURAL	1.442.548,97	0,37%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,39%	16,38%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	0,53%	1,51%	3,10%	6,29%	16,69%	0,20%	0,001%	0,02%
IMA Geral ex-C	1,83%	5,68%	3,24%	6,93%	13,55%	23,86%	-	-	-
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	0,53%	1,49%	3,10%	6,29%	16,40%	0,20%	0,003%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	5,93%	3,44%	7,17%	13,73%	24,05%	0,30%	1,099%	2,94%
IMA-B 5	1,39%	5,47%	3,31%	6,91%	13,22%	24,34%	-	-	-
IPCA	0,32%	0,32%	0,26%	1,10%	3,78%	6,74%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,37%	2,37%	4,69%	6,06%	9,16%	22,46%	0,40%	1,127%	1,50%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,19%	6,79%	4,12%	9,06%	16,39%	28,66%	0,40%	1,285%	4,73%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,94%	1,94%	3,81%	5,34%	5,25%	-	0,40%	0,770%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	5,38%	3,25%	6,83%	13,03%	23,86%	0,20%	0,861%	2,97%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,46%	1,46%	2,92%	6,44%	11,08%	27,60%	0,20%	0,699%	3,02%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,36%	5,37%	3,24%	6,79%	12,99%	23,85%	0,10%	0,862%	2,97%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '900000' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rv.asp, line 51