



Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2019)

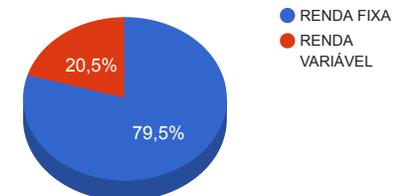
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	49.201.423,79	12,69%	285	4,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	48.299.374,54	12,46%	864	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.851.147,21	4,09%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	23.157.573,75	5,97%	23	6,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	29.471.175,64	7,60%	153	2,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	40.242.336,08	10,38%	488	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	19.698.398,22	5,08%	762	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	31.334.219,23	8,08%	513	0,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	42.337.290,81	10,92%	105	7,61%	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	8.798.878,36	2,27%	74	1,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou D+18 (isento de taxa de	Não há	3.511.116,04	0,91%	1.009	1,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	resgate) D+30	Não há	6.580.037,53	1,70%	6.624	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	5.231.264,78	1,35%	4.901	0,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.236.993,31	2,12%	3.310	1,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	21.121.043,12	5,45%	150	1,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.347.859,96	3,44%	7.336	1,75%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	10.146.769,06	2,62%	47	2,47%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.174.633,14	1,08%	105	0,73%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	952.618,45	0,25%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.451.528,60	0,37%		0,78%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.554.351,98	1,17%		0,19%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			387.700.033,60				

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

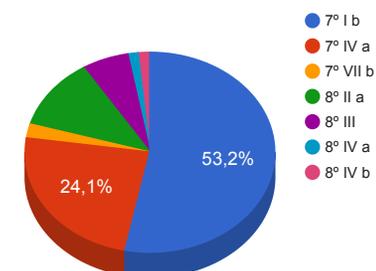
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	206.223.031,01	53,19%	15,00%	35,00%	70,00%	65.166.992,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	15,00%	60,00%	232.620.020,16
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	93.369.908,26	24,08%	5,00%	20,00%	40,00%	61.710.105,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	19.385.001,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	8.798.878,36	2,27%	0,00%	2,50%	5,00%	10.586.123,32
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	44.680.454,78	11,52%	2,00%	12,00%	20,00%	32.859.551,94
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	23.494.629,02	6,06%	2,00%	8,00%	10,00%	15.275.374,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.127.251,59	1,32%	1,00%	2,50%	5,00%	14.257.750,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	6.005.880,58	1,55%	1,00%	2,50%	5,00%	13.379.121,10
Total Carteira		387.700.033,60					

RENDA FIXA	308.391.817,63	79,54%
RENDA VARIÁVEL	79.308.215,97	20,46%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	206.223.031,01	53,19%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	93.369.908,26	24,08%	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 "	8.798.878,36	2,27%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	44.680.454,78	11,52%	2,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	23.494.629,02	6,06%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.127.251,59	1,32%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	6.005.880,58	1,55%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa	387.700.033,60	100,00%	31,00	230,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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	91.538.714,60	23,61%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	84.590.759,87	21,82%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	80.586.212,22	20,79%	0,02%
WESTERN ASSET	46.652.202,77	12,03%	0,10%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	29.471.175,64	7,60%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	21.121.043,12	5,45%	0,00%
Icatu Vanguarda	8.236.993,31	2,12%	0,03%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.580.037,53	1,70%	0,02%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	5.231.264,78	1,35%	0,01%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.554.351,98	1,17%	0,34%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.174.633,14	1,08%	0,03%
Occam Brasil	3.511.116,04	0,91%	0,03%
BRASIL PLURAL	1.451.528,60	0,37%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,68%	2,72%	1,66%	3,30%	7,19%	15,95%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,62%	1,60%	3,17%	6,92%	15,47%	0,20%	0,099%	0,52%
IMA-B	1,51%	7,13%	2,65%	9,89%	15,59%	25,92%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,85%	2,88%	2,25%	0,30%	1,11%	5,46%	0,20%	0,249%	3,85%
IPCA + 6,00% ao ano	0,64%	4,71%	2,92%	5,35%	10,91%	20,84%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,71%	6,34%	3,80%	8,07%	15,63%	27,15%	0,15%	1,086%	4,31%
IMA-B 5	1,11%	4,03%	2,46%	5,60%	9,94%	22,26%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,12%	4,50%	2,27%	7,24%	11,06%	25,77%	0,40%	1,071%	4,90%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,08%	3,96%	2,40%	5,49%	9,72%	22,25%	0,10%	0,638%	3,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	3,95%	2,38%	5,53%	9,73%	22,29%	0,20%	0,637%	3,08%
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	2,54%	1,51%	3,02%	6,24%	14,47%	0,20%	0,004%	0,04%
IPCA	0,13%	2,22%	1,46%	2,37%	4,66%	7,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,72%	7,97%	4,42%	9,40%	14,14%	23,38%	0,002	1,513%	3,44%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,76%	5,50%	3,04%	6,80%	12,96%	-	0,40%	0,976%	2,89%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,24%	5,36%	3,22%	6,52%	13,59%	26,70%	0,20%	0,646%	2,89%

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