



Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	1.303,15	0,00%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	83.080.333,99	93,90%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.742.085,73	1,97%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	84.823.722,87	95,87%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	2.390.850,00	2,70%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.266.000,00	1,43%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	3.656.850,00	4,13%	0,00	0,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 2017)

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	39.614.840,67	44,77%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.749.906,61	35,88%	0,01%
BANRISUL CORRETORA	14.723.672,44	16,64%	0,15%
BLACKROCK INVESTIMENTOS	2.390.850,00	2,70%	0,06%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,62%	10,49%	2,00%	4,92%	11,82%	28,26%	-	-	-
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,60%	10,30%	1,95%	4,84%	11,60%	27,73%	0,20%	0,044%	0,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	10,31%	1,94%	4,82%	11,61%	27,86%	0,20%	0,042%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	10,25%	1,92%	4,80%	11,53%	27,67%	0,10%	0,041%	0,67%
CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	9,44%	1,90%	4,38%	10,68%	26,10%	0,20%	0,040%	0,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	9,37%	1,85%	4,32%	10,58%	26,11%	0,20%	0,019%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	8,38%	1,60%	3,80%	9,52%	23,92%	1,00%	0,004%	0,12%
IPCA	0,28%	2,50%	0,86%	1,06%	2,80%	9,99%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,84%	2,47%	2,24%	1,26%	3,22%	11,36%	0,15%	0,093%	3,98%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,15%	13,75%	1,85%	7,26%	15,62%	40,08%	0,20%	0,793%	4,37%
IDKA IPCA 2 Anos	0,26%	12,31%	1,98%	6,41%	13,75%	31,84%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	9,80%	1,72%	4,69%	11,03%	26,51%	0,20%	0,259%	1,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	9,82%	1,73%	4,70%	11,06%	-	0,20%	0,262%	1,79%
IMA-B 5	0,10%	11,59%	1,60%	6,36%	13,15%	31,60%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	11,41%	1,55%	6,25%	12,95%	30,96%	0,20%	0,890%	3,55%
IMA Geral	0,00%	11,83%	1,47%	5,81%	13,94%	36,68%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2017)

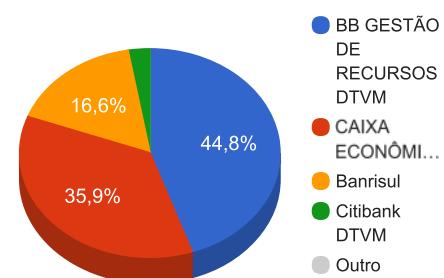
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	-0,01%	11,94%	1,45%	5,61%	13,94%	35,96%	0,20%	1,091%	4,45%
IMA-B	-0,76%	11,87%	0,65%	6,25%	15,12%	41,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,21%	3,90%	1,73%	1,87%	5,07%	15,17%	0,20%	0,263%	4,34%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	-0,69%	11,41%	0,59%	5,97%	14,56%	39,20%	0,35%	2,172%	9,12%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,78%	11,62%	0,59%	6,10%	14,84%	41,03%	0,20%	2,214%	9,44%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,78%	11,65%	0,59%	6,13%	14,86%	41,10%	0,20%	2,219%	9,43%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,86%	6,78%	0,47%	3,52%	8,67%	27,23%	0,20%	2,008%	8,24%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,87%	6,78%	0,47%	3,52%	8,67%	27,22%	0,20%	2,008%	8,23%
IMA Geral ex-C	-0,01%	11,89%	1,45%	5,80%	14,05%	36,86%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,13%	11,26%	1,20%	5,61%	13,40%	-	0,30%	1,303%	5,00%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2017)

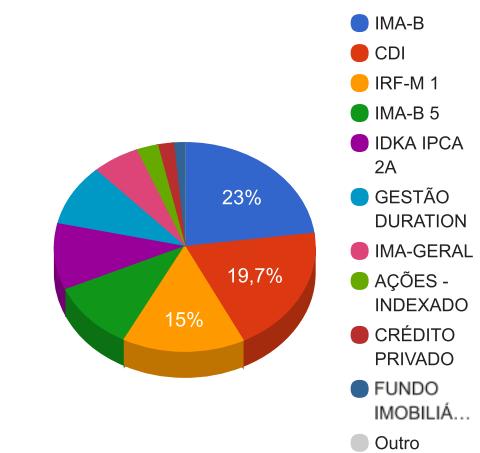
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-3,15%	19,50%	1,60%	14,77%	16,26%	59,51%	-	-	-
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-3,43%	18,87%	1,27%	14,30%	15,69%	58,44%	0,54%	10,866%	19,67%
IFIX	-0,59%	18,73%	6,19%	7,64%	20,47%	52,42%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,93%	4,90%	5,00%	5,94%	9,74%	45,18%	1,20%	6,045%	23,68%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (novembro / 2017)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	39.614.840,67	44,77%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.749.906,61	35,88%
Banrisul	14.723.672,44	16,64%
Citibank DTVM	2.390.850,00	2,70%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.303,15	0,00%

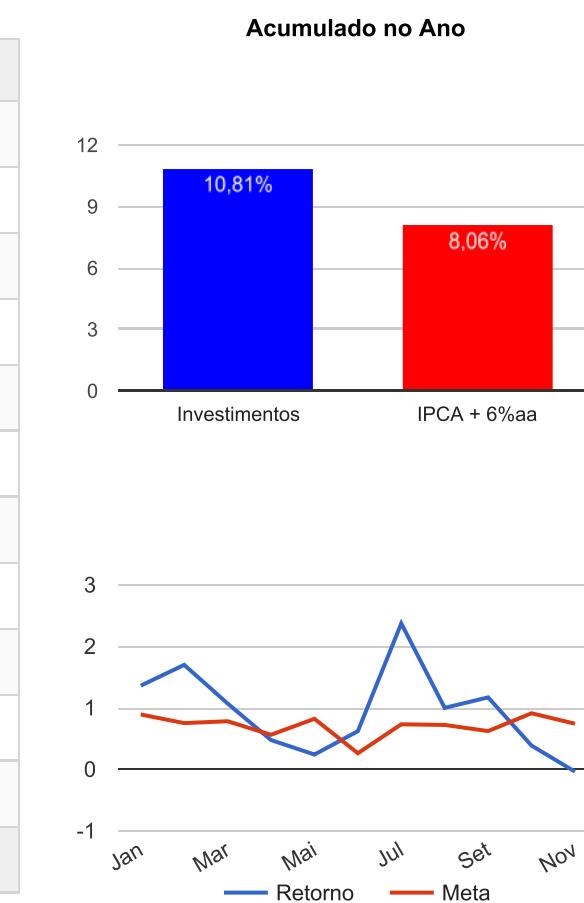


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	20.309.820,29	22,95%
CDI	17.435.556,43	19,71%
IRF-M 1	13.255.351,78	14,98%
IMA-B 5	9.384.320,11	10,61%
IDKA IPCA 2A	9.091.033,38	10,27%
GESTÃO DURATION	8.428.688,98	9,53%
IMA-GERAL	5.175.563,02	5,85%
AÇÕES - INDEXADO	2.390.850,00	2,70%
CRÉDITO PRIVADO	1.742.085,73	1,97%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.266.000,00	1,43%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.303,15	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	76.016.321,52	6.840.417,77	5.468.959,71	78.439.278,32	1.051.498,74	1,36%	0,89%	152,34%	1,58%
Fevereiro	78.439.278,32	3.635.696,80	3.194.580,78	80.219.431,91	1.339.037,57	1,70%	0,75%	226,81%	1,66%
Março	80.219.431,91	2.646.157,08	2.340.547,66	81.385.852,83	860.811,50	1,07%	0,78%	136,25%	1,20%
Abril	81.385.852,83	1.330.393,50	677.227,00	82.427.966,61	388.947,28	0,47%	0,56%	85,02%	0,95%
Maio	82.427.966,61	1.867.142,48	1.423.342,32	83.069.277,15	197.510,38	0,24%	0,82%	29,01%	4,80%
Junho	83.069.277,15	7.290.992,51	6.851.215,20	84.025.354,96	516.300,50	0,62%	0,26%	241,85%	1,30%
Julho	84.025.354,96	2.828.167,16	2.421.708,32	86.434.424,86	2.002.611,06	2,37%	0,73%	325,84%	1,37%
Agosto	86.434.424,86	3.217.512,88	3.218.426,15	87.295.599,70	862.088,11	1,00%	0,72%	137,71%	1,49%
Setembro	87.295.599,70	11.828.022,93	11.838.744,04	88.304.939,29	1.020.060,70	1,17%	0,62%	187,18%	0,92%
Outubro	88.304.939,29	1.757.605,45	1.817.566,76	88.584.187,39	339.209,41	0,38%	0,91%	42,27%	1,18%
Novembro	88.584.187,39	1.547.565,89	1.617.850,35	88.479.269,72	-34.633,21	-0,04%	0,74%	-5,28%	1,16%
Acumulado no ano					8.543.442,04	10,81%	8,06%	134,06%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2017

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	2.485.380,00	498.916,50	539.555,00	2.390.850,00	-53.891,50	-1,81%	10,87%	-3,43%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.295.964,00	0,00	0,00	1.266.000,00	-29.964,00	-2,31%	6,04%	-0,93%
			Total Renda Variável		-83.855,50	-2,22%	9,20%	