

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

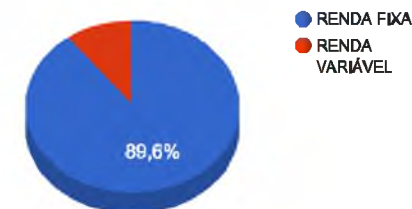
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.449.016,36	4,33%	1.263	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.189.441,95	26,87%	780	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.695.206,86	3,00%	758	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.877.476,24	26,32%	1.466	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	904.303,52	1,60%			Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	2.241.154,27	3,97%	15.529	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	278.863,16	0,49%	793	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	279.728,60	0,49%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.201.728,90	14,51%	424	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	34.177,56	0,06%	673	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	768.443,18	1,36%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	2.097.847,55	3,71%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.650.700,86	2,92%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.383.484,17	2,45%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	18.392,24	0,03%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.516.361,74	4,45%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.029.833,69	1,82%		6,93%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	903.225,75	1,60%		0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			56.519.386,60				

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

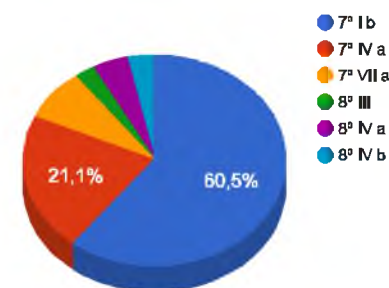
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	34.211.141,41	60,53%	15,00%	25,00%	70,00%	5.352.429,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	33.911.631,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.939.956,01	21,13%	10,00%	30,00%	40,00%	10.667.798,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.516.991,59	7,99%	2,00%	5,00%	5,00%	-1.691.022,26
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	11.303.877,32
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.401.876,41	2,48%	7,00%	10,00%	10,00%	4.250.062,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.516.361,74	4,45%	2,00%	5,00%	5,00%	309.807,59
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.933.059,44	3,42%	2,00%	5,00%	5,00%	892.909,89
Total Carteira		56.519.386,60					

RENTA FIXA	50.668.089,01	89,65%
RENTA VARIÁVEL	5.851.297,59	10,35%

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 "	34.211.141,41	60,53%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.939.956,01	21,13%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.516.991,59	7,99%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.401.876,41	2,48%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.516.361,74	4,45%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.933.059,44	3,42%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	56.519.386,60	100,00%	50,00	240,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.015.566,27	47,80%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.951.499,03	31,76%	0,00%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	2.884.682,97	5,10%	0,44%
A5 CAPITAL PARTNERS	2.516.361,74	4,45%	-
Elleven Gestora de Recursos	2.213.865,81	3,92%	0,18%
Horus GGR	1.650.700,86	2,92%	0,45%
RJI Gestão & Investimentos	1.383.484,17	2,45%	-
ZION Invest	903.225,75	1,60%	0,18%

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

	Mês	
IMA-B 5	1,54%	
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,31%	
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,16%	
IDKA IPCA 2 Anos	1,26%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	
IPCA + 8,00% ao ano	1,00%	
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,88%	
IPCA + 7,00% ao ano	0,91%	
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,85%	
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-1,52%	
IRF-M 1	0,58%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	
CDI	0,54%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2019

Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
1,54%	3,07%	6,93%	10,09%	24,15%	-	-	-
1,31%	-0,59%	0,86%	-10,93%	-4,24%	0,70%	1,586%	8,58%
0,16%	1,20%	1,89%	-19,18%	-13,62%	0,70%	-	-
1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-	-
1,27%	2,57%	5,93%	9,64%	23,04%	0,20%	0,592%	2,36%
1,22%	2,56%	5,85%	9,50%	22,93%	0,20%	0,607%	2,36%
1,00%	2,18%	5,07%	12,01%	24,31%	-	-	-
0,88%	-	5,04%	11,93%	24,47%	0,35%	-	-
0,91%	1,94%	4,58%	10,98%	22,04%	-	-	-
0,85%	2,87%	1,854,54%	1,263,34%	-54,29%	0,00%	-	-
-1,52%	-0,15%	1,18%	-16,09%	-15,25%	1,65%	6,438%	17,69%
0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-	-
0,58%	1,64%	3,60%	6,75%	17,55%	0,10%	0,109%	0,55%
0,57%	1,65%	3,62%	6,80%	17,67%	0,20%	0,099%	0,55%
0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
0,53%	1,49%	3,10%	6,29%	16,40%	0,20%	0,003%	0,04%
0,53%	1,49%	3,04%	6,13%	16,04%	0,20%	0,010%	0,07%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	0,45%	1,27%	2,59%	5,24%	13,98%	1,00%	0,003%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,10%	0,10%	0,29%	0,59%	1,22%	5,40%	5,00%	0,000%	0,01%

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

	Mês	
IFIX	2,47%	
HAZ FII - ATCR11	0,00%	
IPCA + 6,00% ao ano	0,83%	
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,20%	
CDI	0,54%	
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,14%	
Não Informado	-	
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	1,74%	
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	

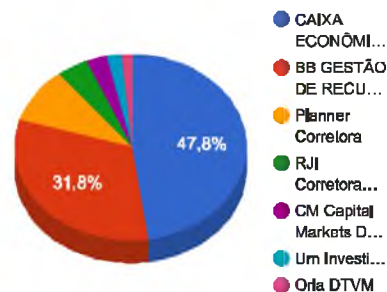
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2019

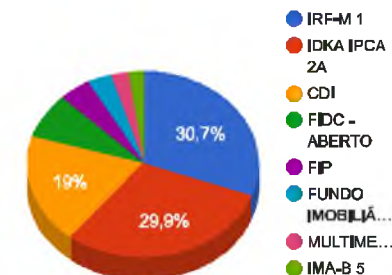
Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
2,47%	7,46%	11,85%	5,45%	24,55%	-	-	-
0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
0,83%	1,71%	4,09%	9,95%	19,79%	-	-	-
-0,20%	-	-	-7,36%	1,48%	1,50%	0,060%	-
0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
0,14%	2,69%	-94,91%	-94,75%	-94,17%	0,00%	0,206%	95,48%
-	-	-	-	-	-	-	-
1,74%	-7,41%	-12,50%	-22,22%	12,18%	1,60%	14,542%	89,77%
-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.015.566,27	47,80%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.951.499,03	31,76%
Planner Corretora	5.517.435,04	9,76%
RJI Corretora de Valores	2.413.317,86	4,27%
CM Capital Markets DTVM	1.650.700,86	2,92%
Um Investimentos	1.184.032,12	2,09%
Orla DTVM	786.835,42	1,39%



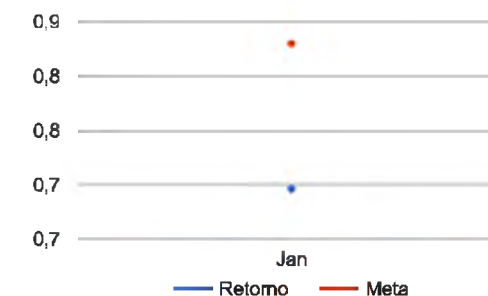
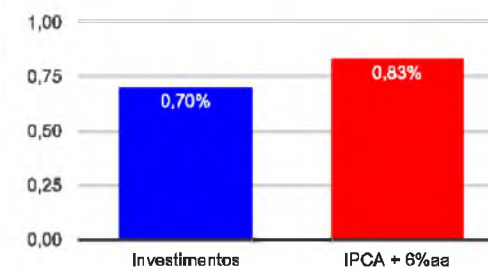
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	17.326.492,60	30,66%
IDKA IPCA 2A	16.884.648,81	29,87%
CDI	10.755.923,89	19,03%
FIDC - ABERTO	4.516.991,59	7,99%
FIP	2.516.361,74	4,45%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.933.059,44	3,42%
MULTIMERCADO	1.401.876,41	2,48%
IMA-B 5	1.184.032,12	2,09%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	55.923.584,98	1.114.829,27	909.763,42	56.519.386,60	390.735,77	0,70%	0,83%	83,71%	0,74%
Acumulado no ano					390.735,77	0,70%	0,83%	83,71%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	276.124,14	0,00	0,00	279.728,60	3.604,46	1,31%	1,59%	1,31%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.612.415,71	61.910,19	0,00	1.695.206,66	20.880,96	1,25%	0,59%	1,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.007.057,53	0,00	0,00	15.189.441,95	182.384,42	1,22%	0,61%	1,22%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.080.623,30	0,00	0,00	2.097.847,55	17.224,25	0,83%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	762.170,33	0,00	0,00	768.443,18	6.272,85	0,82%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.435.007,09	0,00	0,00	2.449.016,36	14.009,27	0,58%	0,11%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.793.463,30	0,00	0,00	14.877.476,24	84.012,94	0,57%	0,10%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	277.392,28	0,00	0,00	278.863,16	1.470,88	0,53%	0,00%	0,53%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.158.683,88	0,00	0,00	8.201.728,90	43.045,02	0,53%	0,01%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.025,12	0,00	0,00	34.177,56	152,44	0,45%	0,00%	0,45%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.681.756,09	0,00	38.013,72	1.650.700,86	6.958,49	0,41%	6,44%	-1,52%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	902.842,53	0,00	0,00	904.303,52	1.460,99	0,16%	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.057.700,73	1.052.919,08	871.749,70	2.241.154,27	2.284,16	0,07%	0,00%	0,10%
Total Renda Fixa					383.761,13	0,76%	0,49%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	887.741,88	0,00	0,00	903.225,75	15.483,87	1,74%	14,54%	2,27%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.366,51	0,00	0,00	18.392,24	25,73	0,14%	0,21%	0,14%
HAZ FII - ATCR11	1.031.282,60	0,00	0,00	1.029.833,69	-1.448,91	-0,14%	-	0,00%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	2.520.742,38	0,00	0,00	2.516.361,74	-4.380,64	-0,17%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.386.189,58	0,00	0,00	1.383.484,17	-2.705,41	-0,20%	0,06%	-0,20%
Total Renda Variável					6.974,64	0,12%	5,74%	