

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017



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

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	310.994,79	0,41%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.650.075,56	6,18%	706	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	30.884.835,97	41,07%	1.367	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.760.657,06	36,92%	1.197	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.879.911,60	2,50%	686	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.221.652,26	1,62%	772	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.490.406,06	11,29%	766	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV
Total para cálculo dos limites da Resolução			75.198.533,30				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			150,00				Artigo 6º
Total			75.198.683,30				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (julho / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	2,50%	1.879.963,33
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	65.486.474,98	87,08%	20,00%	29,50%	70,00%	-12.847.501,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	45.119.119,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	22.559.559,99
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.279.780,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.759.926,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.759.926,67
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.255.956,00
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	9.023.824,00
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.759.926,67
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.759.926,67
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.759.926,67
DF - Artigo 6º	100,00%	150,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-150,00
Total Carteira		65.486.624,98					

RENDA FIXA	75.198.683,30	114,83%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	65.486.474,98	87,08%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	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	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	12,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	150,00	0,00%	0,00%	0,00%
Total	65.486.624,98	87,08%	56,00	217,50

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	2,527%	9,07%	3,80%	7,90%	14,69%	32,93%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,44%	8,29%	3,47%	7,12%	13,62%	31,55%	0,20%	0,949%	2,92%
IRF-M	2,307%	10,74%	4,00%	8,27%	17,91%	37,45%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,31%	10,59%	3,92%	8,10%	17,68%	36,85%	0,20%	1,028%	4,87%
IRF-M 1	1,049%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,23%	2,83%	5,89%	13,20%	29,51%	0,10%	0,212%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	7,25%	2,84%	5,92%	13,28%	29,76%	0,20%	0,199%	0,66%
CDI	0,797%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	6,56%	2,56%	5,40%	12,68%	28,28%	0,20%	0,007%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	6,53%	2,56%	5,40%	12,54%	28,36%	0,20%	0,017%	0,10%
IPCA	0,240%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,53%	8,48%	3,33%	7,27%	13,36%	31,25%	0,20%	1,028%	3,60%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.375.242,03	52,36%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.823.291,27	47,64%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	150,00	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	58.645.493,03	77,99%
CDI	9.712.058,32	12,92%
IDKA IPCA 2A	4.650.075,56	6,18%
IRF-M	1.879.911,60	2,50%
IMA-B 5	310.994,79	0,41%
DISP. FINANCEIRA	150,00	0,00%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	69.676.835,14	243.291,75	574.958,38	70.218.443,07	873.274,56	1,25%	0,89%	140,52%	0,33%
Fevereiro	70.218.443,07	574.894,55	411.601,33	70.663.859,76	282.123,47	0,40%	0,75%	53,56%	0,13%
Março	70.663.859,76	898.581,15	429.781,52	72.352.614,43	1.219.955,04	1,72%	0,78%	218,60%	0,18%
Abril	72.352.614,43	556.944,44	437.798,06	73.077.627,22	605.866,41	0,84%	0,56%	149,91%	0,19%
Mai	73.077.627,22	587.071,66	463.200,00	73.824.816,60	623.317,72	0,85%	0,82%	103,64%	1,16%
Junho	73.824.816,60	441.565,43	683.135,45	74.214.854,42	631.607,84	0,86%	0,26%	334,67%	0,22%
Julho	74.214.854,42	611.579,77	473.785,20	75.198.533,30	845.884,31	1,14%	0,73%	156,29%	0,25%
Acumulado no ano					5.082.029,35	7,26%	4,89%	148,62%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	303.332,60	0,00	0,00	310.994,79	7.662,19	2,53%	1,03%	2,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.379.554,49	160.312,90	0,00	4.650.075,56	110.208,17	2,43%	0,95%	2,44%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.828.448,55	9.129,37	0,00	1.879.911,60	42.333,68	2,30%	1,03%	2,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.566.105,18	0,00	0,00	30.884.835,97	318.730,79	1,04%	0,20%	1,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.643.360,95	299.735,96	473.785,20	27.760.657,06	291.345,35	1,04%	0,21%	1,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.424.237,52	0,00	0,00	8.490.406,06	66.168,54	0,79%	0,02%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.069.815,13	142.401,54	0,00	1.221.652,26	9.435,59	0,78%	0,01%	0,81%
Total Renda Fixa					845.884,31	1,14%	0,25%	

