

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 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	305.411,80	0,40%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.858.328,60	6,38%	707	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	31.159.607,37	40,93%	1.381	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.949.672,28	36,71%	1.211	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.908.602,29	2,51%	688	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.231.338,86	1,62%	766	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.557.620,29	11,24%	771	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>75.970.581,49</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			162.390,23				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>76.132.971,72</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (agosto / 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%	1.899.264,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	66.181.622,34	87,11%	20,00%	29,50%	70,00%	-13.002.215,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	45.582.348,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	22.791.174,45
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.395.587,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.798.529,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.798.529,07
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.279.117,44
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	9.116.469,78
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.798.529,07
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.798.529,07
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.798.529,07
DF - Artigo 6º	100,00%	162.390,23	0,21%	0,00%	0,00%	0,00%	-162.390,23
<b>Total Carteira</b>		<b>66.344.012,57</b>					

RENDA FIXA	76.132.971,72	114,75%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 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 '	66.181.622,34	86,93%	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	162.390,23	0,21%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>66.344.012,57</b>	<b>87,14%</b>	<b>56,00</b>	<b>217,50</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,057%	11,91%	4,79%	7,25%	18,00%	40,09%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	11,73%	4,73%	7,08%	17,74%	39,52%	0,20%	0,975%	4,87%
IDKA IPCA 2 Anos	0,966%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%
IRF-M 1	0,901%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
CDI	0,801%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	7,40%	2,43%	5,30%	12,17%	27,88%	0,20%	0,003%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	7,38%	2,42%	5,31%	12,08%	27,93%	0,20%	0,007%	0,11%
IPCA	0,190%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	9,56%	4,09%	6,64%	13,51%	33,62%	0,20%	0,547%	3,58%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.717.227,66	52,17%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.253.353,83	47,62%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	162.390,23	0,21%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	59.109.279,65	77,64%
CDI	9.788.959,15	12,86%
IDKA IPCA 2A	4.858.328,60	6,38%
IRF-M	1.908.602,29	2,51%
IMA-B 5	305.411,80	0,40%
DISP. FINANCEIRA	162.390,23	0,21%

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%
Agosto	75.198.533,30	605.193,88	499.147,29	75.970.581,49	666.001,60	0,88%	0,72%	122,11%	0,12%
Acumulado no ano					5.748.030,95	8,21%	5,65%	145,43%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.879.911,60	9.129,37	0,00	1.908.602,29	19.561,32	1,04%	0,98%	1,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.650.075,56	161.114,46	0,00	4.858.328,60	47.138,58	0,98%	0,49%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	310.994,79	0,00	8.611,73	305.411,80	3.028,74	0,97%	0,55%	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.884.835,97	0,00	0,00	31.159.607,37	274.771,40	0,89%	0,08%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.760.657,06	434.950,05	490.535,56	27.949.672,28	244.600,73	0,87%	0,08%	0,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.221.652,26	0,00	0,00	1.231.338,86	9.686,60	0,79%	0,00%	0,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.490.406,06	0,00	0,00	8.557.620,29	67.214,23	0,79%	0,01%	0,79%
Total Renda Fixa					666.001,60	0,88%	0,12%	



