

# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 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	308.085,79	0,40%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.063.272,34	6,61%	701	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	31.382.287,82	40,95%	1.382	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.090.278,94	36,65%	1.221	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.945.564,62	2,54%	696	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.239.338,12	1,62%	763	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.611.874,57	11,24%	776	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>76.640.702,20</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			150,00				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>76.640.852,20</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (setembro / 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%	1.916.017,56
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	66.789.489,51	87,15%	20,00%	29,50%	70,00%	-13.140.997,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	45.984.421,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	22.992.210,66
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.496.105,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.832.035,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.832.035,11
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.299.221,07
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	9.196.884,26
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.832.035,11
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.832.035,11
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.832.035,11
DF - Artigo 6º	100,00%	150,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-150,00
<b>Total Carteira</b>		<b>66.789.639,51</b>					

RENDA FIXA	76.640.852,20	114,75%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 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 '	66.789.489,51	87,15%	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%
<b>Total</b>	<b>66.789.639,51</b>	<b>87,15%</b>	<b>56,00</b>	<b>217,50</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,479%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	13,36%	4,87%	7,06%	17,16%	43,01%	0,20%	1,005%	4,84%
IDKA IPCA 2 Anos	0,911%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	10,29%	4,33%	6,18%	12,73%	33,31%	0,20%	0,476%	2,90%
IRF-M 1	0,745%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%
CDI	0,638%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,06%	2,23%	4,86%	11,56%	27,32%	0,20%	0,017%	0,12%
IPCA	0,160%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	10,51%	4,45%	5,97%	12,92%	33,75%	0,20%	0,487%	3,55%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.994.162,39	52,18%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.646.539,81	47,82%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	150,00	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	59.472.566,76	77,60%
CDI	9.851.212,69	12,85%
IDKA IPCA 2A	5.063.272,34	6,61%
IRF-M	1.945.564,62	2,54%
IMA-B 5	308.085,79	0,40%
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%
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%
Setembro	75.970.581,49	605.717,09	493.239,36	76.640.702,20	557.642,98	0,73%	0,62%	117,41%	0,12%
Acumulado no ano					6.305.673,93	9,00%	6,30%	142,79%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	1.908.602,29	9.129,37	0,00	1.945.564,62	27.832,96	1,45%	1,00%	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	305.411,80	0,00	0,00	308.085,79	2.673,99	0,88%	0,49%	0,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.858.328,60	161.920,03	0,00	5.063.272,34	43.023,71	0,86%	0,48%	0,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.159.607,37	0,00	0,00	31.382.287,82	222.680,45	0,71%	0,07%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.949.672,28	434.667,69	493.239,36	28.090.278,94	199.178,33	0,70%	0,07%	0,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.231.338,86	0,00	0,00	1.239.338,12	7.999,26	0,65%	0,01%	0,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.557.620,29	0,00	0,00	8.611.874,57	54.254,28	0,63%	0,02%	0,63%
Total Renda Fixa					557.642,98	0,73%	0,12%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.566.105,18	0,00	0,00	31.382.287,82	816.182,64	2,67%	2,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.643.360,95	1.169.353,70	1.457.560,12	28.090.278,94	735.124,41	2,63%	2,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.379.554,49	483.347,39	0,00	5.063.272,34	200.370,46	4,32%	4,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.424.237,52	0,00	0,00	8.611.874,57	187.637,05	2,23%	2,23%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.828.448,55	27.388,11	0,00	1.945.564,62	89.727,96	4,86%	4,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.069.815,13	142.401,54	0,00	1.239.338,12	27.121,45	2,24%	2,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	303.332,60	0,00	8.611,73	308.085,79	13.364,92	4,43%	4,45%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.069.528,89</b>	<b>2,78%</b>	

