

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 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	310.144,64	0,40%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.429.159,11	7,01%	700	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	31.576.796,23	40,80%	1.377	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.207.703,57	36,45%	1.223	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.956.206,21	2,53%	699	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.247.720,86	1,61%	756	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.668.206,65	11,20%	764	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV
Total para cálculo dos limites da Resolução			77.395.937,27				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			258,45				Artigo 6º
Total			77.396.195,72				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (outubro / 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%	1.934.898,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	67.480.009,76	87,19%	20,00%	29,50%	70,00%	-13.302.853,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	46.437.562,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	23.218.781,18
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.609.390,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.869.796,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.869.796,86
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.321.878,12
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	9.287.512,47
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.869.796,86
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.869.796,86
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.869.796,86
DF - Artigo 6º	100,00%	258,45	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-258,45
Total Carteira		67.480.268,21					

RENDA FIXA	77.396.195,72	114,69%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 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 '	67.480.009,76	87,19%	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	258,45	0,00%	0,00%	0,00%
Total	67.480.268,21	87,19%	56,00	217,50

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

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA DTVM	40.245.002,88	52,00%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.150.934,39	48,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,801%	12,02%	2,70%	6,61%	14,10%	31,77%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	11,12%	2,62%	6,18%	13,11%	30,79%	0,20%	0,577%	2,89%
CDI	0,643%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,68%	8,83%	2,13%	4,75%	11,22%	26,72%	0,20%	0,029%	0,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,65%	8,76%	2,09%	4,71%	11,12%	26,74%	0,20%	0,022%	0,12%
IRF-M 1	0,620%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	9,66%	2,24%	5,14%	12,09%	28,45%	0,20%	0,091%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	9,60%	2,21%	5,11%	12,01%	28,25%	0,10%	0,077%	0,68%
IPCA	0,420%	2,21%	0,77%	1,09%	2,70%	10,79%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	11,25%	2,56%	5,97%	13,17%	31,67%	0,20%	0,676%	3,52%
IRF-M	0,103%	13,68%	2,66%	6,77%	16,15%	42,35%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	13,44%	2,59%	6,60%	15,82%	41,81%	0,20%	1,104%	4,83%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.245.002,88	52,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.150.934,39	48,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	258,45	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	59.784.499,80	77,24%
CDI	9.915.927,51	12,81%
IDKA IPCA 2A	5.429.159,11	7,01%
IRF-M	1.956.206,21	2,53%
IMA-B 5	310.144,64	0,40%
DISP. FINANCEIRA	258,45	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%
Outubro	76.640.702,20	771.004,89	489.729,88	77.395.937,27	473.960,06	0,62%	0,91%	67,80%	0,14%
Acumulado no ano					6.779.633,99	9,67%	7,27%	133,06%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.063.272,34	326.272,92	0,00	5.429.159,11	39.613,85	0,74%	0,58%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.239.338,12	0,00	0,00	1.247.720,86	8.382,74	0,68%	0,03%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	308.085,79	0,00	0,00	310.144,64	2.058,85	0,67%	0,68%	0,67%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.611.874,57	0,00	0,00	8.668.206,65	56.332,08	0,65%	0,02%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.382.287,82	0,00	0,00	31.576.796,23	194.508,41	0,62%	0,09%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.090.278,94	435.602,60	489.729,88	28.207.703,57	171.551,91	0,60%	0,08%	0,61%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.945.564,62	9.129,37	0,00	1.956.206,21	1.512,22	0,08%	1,10%	0,08%
Total Renda Fixa					473.960,06	0,62%	0,14%	

