

# Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano 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 (dezembro / 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	312.617,78	0,40%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.657.136,69	7,19%	712	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	31.944.229,81	40,60%	1.412	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.393.279,31	36,09%	1.226	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.986.084,02	2,52%	677	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.620.978,68	2,06%	757	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.761.906,62	11,14%	748	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV
<b>Total</b>			<b>78.676.232,91</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 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%	1.966.905,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	68.293.347,61	86,80%	20,00%	29,50%	70,00%	-13.219.984,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	47.205.739,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	23.602.869,87
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.801.434,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.933.811,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.933.811,65
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.360.286,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	9.441.147,95
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.933.811,65
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.933.811,65
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.933.811,65
<b>Total Carteira</b>		<b>68.293.347,61</b>					

RENDA FIXA	78.676.232,91	115,20%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 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 '	68.293.347,61	86,80%	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%
<b>Total</b>	<b>68.293.347,61</b>	<b>86,80%</b>	<b>56,00</b>	<b>217,50</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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	40.706.136,43	51,74%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.970.096,48	48,26%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,245%	15,20%	1,44%	6,42%	15,20%	42,12%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	14,91%	1,37%	6,31%	14,91%	41,58%	0,20%	0,842%	4,57%
IDKA IPCA 2 Anos	1,162%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	12,40%	1,91%	6,33%	12,40%	29,14%	0,20%	0,463%	2,75%
IRF-M 1	0,566%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	4,51%	10,93%	27,11%	0,20%	0,031%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	10,86%	1,77%	4,48%	10,86%	26,92%	0,10%	0,040%	0,68%
CDI	0,538%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	10,08%	1,83%	4,14%	10,08%	25,36%	0,20%	0,068%	0,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,94%	1,74%	4,01%	9,94%	25,33%	0,20%	0,021%	0,13%
IPCA	0,440%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	12,14%	1,47%	5,99%	12,14%	29,09%	0,20%	0,454%	3,25%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.706.136,43	51,74%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.970.096,48	48,26%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	60.337.509,12	76,69%
CDI	10.382.885,30	13,20%
IDKA IPCA 2A	5.657.136,69	7,19%
IRF-M	1.986.084,02	2,52%
IMA-B 5	312.617,78	0,40%

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%
Novembro	77.395.937,27	634.429,76	486.100,00	77.970.736,78	426.469,75	0,55%	0,74%	74,32%	0,11%
Dezembro	77.970.736,78	979.642,67	741.969,67	78.676.232,91	467.823,13	0,60%	0,91%	66,06%	0,09%
Acumulado no ano					7.673.926,87	10,94%	9,04%	120,94%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 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	1.966.655,29	0,00	4.589,67	1.986.084,02	24.018,40	1,22%	0,84%	1,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.444.617,80	164.361,00	0,00	5.657.136,69	48.157,89	0,86%	0,46%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	310.296,94	0,00	0,00	312.617,78	2.320,84	0,75%	0,45%	0,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.431.740,26	179.894,59	0,00	1.620.978,68	9.343,83	0,58%	0,07%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.763.865,11	0,00	0,00	31.944.229,81	180.364,70	0,57%	0,03%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.337.293,40	635.387,08	737.380,00	28.393.279,31	157.978,83	0,55%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.716.267,98	0,00	0,00	8.761.906,62	45.638,64	0,52%	0,02%	0,52%
Total Renda Fixa					467.823,13	0,60%	0,09%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º 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	31.382.287,82	0,00	0,00	31.944.229,81	561.941,99	1,79%	1,79%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.090.278,94	1.519.694,95	1.713.209,88	28.393.279,31	496.515,30	1,74%	1,77%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.611.874,57	0,00	0,00	8.761.906,62	150.032,05	1,74%	1,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.063.272,34	490.633,92	0,00	5.657.136,69	103.230,43	1,89%	1,91%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.945.564,62	18.258,74	4.589,67	1.986.084,02	26.850,33	1,37%	1,37%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.239.338,12	356.489,71	0,00	1.620.978,68	25.150,85	1,79%	1,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	308.085,79	0,00	0,00	312.617,78	4.531,99	1,47%	1,47%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.368.252,94</b>	<b>1,77%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 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	28.795.892,82	0,00	0,00	31.944.229,81	3.148.336,99	10,93%	10,93%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.773.135,23	4.952.162,94	6.160.343,41	28.393.279,31	2.828.324,55	10,63%	10,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.969.721,72	0,00	0,00	8.761.906,62	792.184,90	9,94%	9,94%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.379.927,75	1.763.661,21	0,00	5.657.136,69	513.547,73	12,23%	12,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.639.948,13	99.649,58	4.589,67	1.986.084,02	251.075,98	14,89%	14,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	823.188,06	694.443,31	2.380,00	1.620.978,68	105.727,31	9,94%	10,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	295.021,43	0,00	17.133,06	312.617,78	34.729,41	12,10%	12,14%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>7.673.926,87</b>	<b>10,94%</b>	

