

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	41.076.924,71	62,43%	1.211	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.258.946,25	3,43%	49	1,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.344.242,78	9,64%	1.381	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	575.354,23	0,87%	195	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	17.449,66	0,03%	628	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	62.599,96	0,10%	766	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.801.184,13	7,30%	771	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.016.845,49	13,70%	2.943	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.643.093,83	2,50%	65	0,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total			65.796.641,04				

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 ' b '	100,00%	50.255.467,97	76,38%	50,00%	70,00%	100,00%	15.541.173,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	39.477.984,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	39.477.984,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	15.541.173,07	23,62%	0,00%	0,00%	30,00%	4.197.819,24
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	9.869.496,16
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	16.449.160,26
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.289.832,05
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.289.832,05
Total Carteira		65.796.641,04					

RENTA FIXA	65.796.641,04	100,00%
------------	---------------	---------

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%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	50.255.467,97	76,38%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	15.541.173,07	23,62%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	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%	25,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total	65.796.641,04	100,00%	0,00	475,00

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
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,20%	10,65%	4,94%	5,10%	14,67%	41,56%	0,20%	1,441%	8,18%

IRF-M 1+	1,11%	13,22%	5,47%	7,73%	19,92%	45,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	13,00%	5,39%	7,45%	19,66%	45,75%	0,20%	1,312%	6,45%

IRF-M 1	0,90%	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	0,80%	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%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,76%	7,22%	2,43%	5,17%	11,28%	26,64%	0,50%	0,020%	0,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%

IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,08%	8,71%	3,60%	5,82%	-	-	0,20%	0,453%	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.156.974,33	62,55%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.363.874,97	20,31%
Santander Securities Services	11.275.791,74	17,14%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	47.421.167,49	72,07%
CDI	13.898.079,24	21,12%
IMA-B	2.258.946,25	3,43%
GESTÃO DURATION	1.643.093,83	2,50%
IRF-M 1+	575.354,23	0,87%

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	57.633.174,85	0,00	233.782,97	58.115.238,99	715.847,11	1,24%	0,89%	139,26%	0,37%
Fevereiro	58.115.238,99	1.153.317,10	233.351,97	59.668.820,81	633.616,69	1,07%	0,75%	143,40%	0,17%
Março	59.668.820,81	678.308,31	255.954,32	60.750.280,14	659.105,34	1,10%	0,78%	139,80%	0,22%
Abril	60.750.280,14	1.572.259,26	1.000.911,12	61.799.880,49	478.252,21	0,78%	0,56%	139,85%	0,22%
Maiο	61.799.880,49	738.526,00	250.964,88	62.784.947,32	497.505,71	0,80%	0,82%	97,22%	1,34%
Junho	62.784.947,32	735.988,95	289.886,74	63.751.531,55	520.482,02	0,82%	0,26%	322,00%	0,23%
Julho	63.751.531,55	1.365.690,15	1.058.666,75	64.773.286,34	714.731,39	1,12%	0,73%	153,28%	0,25%
Agosto	64.773.286,34	1.631.351,12	1.174.212,38	65.796.641,04	566.215,96	0,87%	0,72%	119,85%	0,13%
Acumulado no ano					4.785.756,43	8,07%	5,65%	142,91%	

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(%)
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.232.073,34	0,00	0,00	2.258.946,25	26.872,91	1,20%	1,44%	1,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.625.522,20	0,00	0,00	1.643.093,83	17.571,63	1,08%	0,45%	1,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	569.389,83	0,00	0,00	575.354,23	5.964,40	1,05%	1,31%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.288.298,03	0,00	0,00	6.344.242,78	55.944,75	0,89%	0,08%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.283.526,40	812.710,69	372.313,58	41.076.924,71	353.001,20	0,86%	0,08%	0,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	62.107,52	0,00	0,00	62.599,96	492,44	0,79%	0,00%	0,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.763.474,14	0,00	0,00	4.801.184,13	37.709,99	0,79%	0,01%	0,79%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.948.894,88	0,00	0,00	9.016.845,49	67.950,61	0,76%	0,02%	0,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	818.640,43	801.898,80	17.449,66	708,03	0,09%	0,00%	0,70%
Total Renda Fixa					566.215,96	0,87%	0,13%	