

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	569.389,83	0,88%	185	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	40.283.526,40	62,18%	1.197	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.232.073,34	3,45%	47	1,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.288.298,03	9,71%	1.367	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.948.894,88	13,81%	2.808	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.625.522,20	2,51%	57	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	62.107,52	0,10%	772	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.763.474,14	7,35%	766	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			64.773.286,34				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			11.778,42	Artigo 6º			
Total			64.785.064,76				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (julho / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	49.373.287,60	76,22%	50,00%	70,00%	100,00%	15.399.998,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	38.863.971,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	38.863.971,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	15.399.998,74	23,78%	0,00%	0,00%	30,00%	4.031.987,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	9.715.992,95
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	16.193.321,59
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.238.664,32
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.238.664,32
DF - Artigo 6º	100,00%	11.778,42	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-11.778,42
Total Carteira		64.785.064,76					

RENTA FIXA	64.785.064,76	100,00%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 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 '	49.373.287,60	76,21%	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 '	15.399.998,74	23,77%	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%
DF - Artigo 6º	11.778,42	0,02%	0,00%	0,00%
Total	64.785.064,76	100,00%	0,00	475,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	4,00%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3,41%	9,33%	2,94%	7,46%	14,51%	35,72%	0,20%	1,815%	8,20%

IRF-M 1+	2,76%	11,98%	4,41%	9,07%	19,64%	41,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,77%	11,82%	4,40%	8,89%	19,48%	41,17%	0,20%	1,341%	6,47%

IRF-M 1	1,05%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,23%	2,83%	5,89%	13,20%	29,51%	0,10%	0,212%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	7,25%	2,84%	5,92%	13,28%	29,76%	0,20%	0,199%	0,66%

CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,83%	6,42%	2,50%	5,31%	11,72%	26,95%	0,50%	0,035%	0,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	6,56%	2,56%	5,40%	12,68%	28,28%	0,20%	0,007%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	6,53%	2,56%	5,40%	12,54%	28,36%	0,20%	0,017%	0,10%

IPCA	0,24%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,05%	7,54%	2,78%	6,32%	-	-	0,20%	0,796%	-

Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
--------------	---	---	---	---	---	---	---	---	---

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	40.345.633,92	62,28%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.246.684,20	20,45%
Santander Securities Services	11.180.968,22	17,26%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	11.778,42	0,02%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	46.571.824,43	71,89%
CDI	13.774.476,54	21,26%
IMA-B	2.232.073,34	3,45%
GESTÃO DURATION	1.625.522,20	2,51%
IRF-M 1+	569.389,83	0,88%
DISP. FINANCEIRA	11.778,42	0,02%

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%
Acumulado no ano					4.219.540,47	7,14%	4,89%	146,10%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.158.435,73	0,00	0,00	2.232.073,34	73.637,61	3,41%	1,81%	3,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	554.040,98	0,00	0,00	569.389,83	15.348,85	2,77%	1,34%	2,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.592.800,22	0,00	0,00	1.625.522,20	32.721,98	2,05%	0,80%	2,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.223.402,94	0,00	0,00	6.288.298,03	64.895,09	1,04%	0,20%	1,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.559.963,74	1.365.690,15	1.058.666,75	40.283.526,40	416.539,26	1,02%	0,21%	1,06%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.874.925,98	0,00	0,00	8.948.894,88	73.968,90	0,83%	0,03%	0,83%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	61.611,16	0,00	0,00	62.107,52	496,36	0,81%	0,01%	0,81%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.726.350,80	0,00	0,00	4.763.474,14	37.123,34	0,79%	0,02%	0,79%
Total Renda Fixa					714.731,39	1,12%	0,25%	