

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 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	554.040,98	0,87%	178	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	39.559.963,74	62,05%	1.197	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.158.435,73	3,39%	46	1,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.223.402,94	9,76%	1.360	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.726.350,80	7,41%	757	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.874.925,98	13,92%	2.698	0,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.592.800,22	2,50%	55	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	61.611,16	0,10%	774	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			63.751.531,55				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.396,91	Artigo 6º			
Total			63.756.928,46				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	48.495.843,39	76,07%	50,00%	70,00%	100,00%	15.255.688,16
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	38.250.918,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	38.250.918,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	15.255.688,16	23,93%	0,00%	0,00%	30,00%	3.869.771,30
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	9.562.729,73
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	15.937.882,89
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.187.576,58
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.187.576,58
DF - Artigo 6º	100,00%	5.396,91	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.396,91
Total Carteira		63.756.928,46					

RENTA FIXA	63.756.928,46	100,00%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 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 '	48.495.843,39	76,06%	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 '	15.255.688,16	23,93%	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	5.396,91	0,01%	0,00%	0,00%
Total	63.756.928,46	100,00%	0,00	475,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	8,81%	1,92%	8,81%	17,98%	38,93%	0,20%	1,814%	6,47%

IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	6,11%	2,63%	6,11%	13,17%	29,76%	0,10%	0,182%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%

CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,70%	2,57%	5,70%	12,90%	28,87%	0,20%	0,015%	0,09%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,81%	5,54%	2,43%	5,54%	12,14%	27,35%	0,50%	0,029%	0,34%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%

IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,27%	5,72%	-0,62%	5,72%	13,25%	30,39%	0,20%	1,937%	8,21%

IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,43%	5,38%	1,13%	5,38%	-	-	0,20%	0,695%	-

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

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	39.621.574,90	62,14%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.096.594,94	20,54%
Santander Securities Services	11.033.361,71	17,31%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.396,91	0,01%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	45.783.366,68	71,81%
CDI	13.662.887,94	21,43%
IMA-B	2.158.435,73	3,39%
GESTÃO DURATION	1.592.800,22	2,50%
IRF-M 1+	554.040,98	0,87%
DISP. FINANCEIRA	5.396,91	0,01%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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%
Acumulado no ano					3.504.809,08	5,96%	4,13%	144,29%	

Acumulado no Ano

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	545.913,52	0,00	0,00	554.040,98	8.127,46	1,49%	1,81%	1,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.170.023,82	0,00	0,00	6.223.402,94	53.379,12	0,87%	0,18%	0,87%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.778.272,25	735.988,95	289.886,74	39.559.963,74	335.589,28	0,85%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.687.704,90	0,00	0,00	4.726.350,80	38.645,90	0,82%	0,02%	0,82%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.803.272,42	0,00	0,00	8.874.925,98	71.653,56	0,81%	0,03%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	61.113,80	0,00	0,00	61.611,16	497,36	0,81%	0,03%	0,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.586.016,52	0,00	0,00	1.592.800,22	6.783,70	0,43%	0,69%	0,43%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.152.630,09	0,00	0,00	2.158.435,73	5.805,64	0,27%	1,94%	0,27%
Total Renda Fixa					520.482,02	0,82%	0,23%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.064.826,50	3.046.774,21	1.541.762,74	39.559.963,74	990.125,77	2,56%	2,63%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.664.274,08	0,00	0,00	8.874.925,98	210.651,90	2,43%	2,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.062.619,76	0,00	0,00	6.223.402,94	160.783,18	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.607.882,08	0,00	0,00	4.726.350,80	118.468,72	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.575.057,67	0,00	0,00	1.592.800,22	17.742,55	1,13%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	543.583,53	0,00	0,00	554.040,98	10.457,45	1,92%	1,92%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	60.084,98	0,00	0,00	61.611,16	1.526,18	2,54%	2,54%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.171.951,54	0,00	0,00	2.158.435,73	-13.515,81	-0,62%	-0,62%
Total Renda Fixa					1.496.239,94	2,42%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.768.925,85	4.878.399,62	2.264.852,00	39.559.963,74	2.177.490,27	6,00%	6,11%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.409.354,81	0,00	0,00	8.874.925,98	465.571,17	5,54%	5,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.862.979,37	0,00	0,00	6.223.402,94	360.423,57	6,15%	6,15%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.471.348,36	0,00	0,00	4.726.350,80	255.002,44	5,70%	5,70%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.041.611,30	0,00	0,00	2.158.435,73	116.824,43	5,72%	5,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.511.487,99	0,00	0,00	1.592.800,22	81.312,23	5,38%	5,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	509.181,56	0,00	0,00	554.040,98	44.859,42	8,81%	8,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	58.285,61	0,00	0,00	61.611,16	3.325,55	5,71%	5,71%
Total Renda Fixa					3.504.809,08	5,96%	