

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 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	41.911.283,16	62,73%	1.221	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.296.639,06	3,44%	51	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.389.581,58	9,56%	1.382	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	585.017,52	0,88%	196	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.464,73	0,01%	642	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	63.006,65	0,09%	763	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.831.623,07	7,23%	776	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.072.455,63	13,58%	3.032	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.656.380,30	2,48%	66	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total			66.814.451,70				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	51.182.521,32	76,60%	50,00%	70,00%	100,00%	15.631.930,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	40.088.671,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	40.088.671,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	15.631.930,38	23,40%	0,00%	0,00%	30,00%	4.412.405,13
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	10.022.167,76
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	16.703.612,93
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.340.722,59
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.340.722,59
Total Carteira		66.814.451,70					

RENTA FIXA	66.814.451,70	100,00%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 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'	51.182.521,32	76,60%	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'	15.631.930,38	23,40%	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	66.814.451,70	100,00%	0,00	475,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,67%	12,49%	6,40%	5,74%	14,88%	45,16%	0,20%	1,201%	8,15%

IRF-M 1+	1,73%	15,17%	5,69%	7,83%	19,22%	51,80%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,68%	14,89%	5,59%	7,62%	18,92%	51,25%	0,20%	1,331%	6,40%

IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%

CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,06%	2,23%	4,86%	11,56%	27,32%	0,20%	0,017%	0,12%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,62%	7,89%	2,23%	4,71%	10,78%	26,09%	0,50%	0,019%	0,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,26%	1,99%	4,33%	10,54%	25,16%	1,00%	0,013%	0,11%

IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,81%	9,59%	3,99%	5,16%	-	-	0,20%	0,441%	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.982.754,54	62,83%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.462.602,47	20,15%
Santander Securities Services	11.369.094,69	17,02%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	48.300.864,74	72,29%
CDI	13.975.550,08	20,92%
IMA-B	2.296.639,06	3,44%
GESTÃO DURATION	1.656.380,30	2,48%
IRF-M 1+	585.017,52	0,88%

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%
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%
Setembro	65.796.641,04	1.637.815,82	1.105.073,37	66.814.451,70	485.068,21	0,73%	0,62%	117,15%	0,12%
Acumulado no ano					5.270.824,64	8,86%	6,30%	140,50%	

Acumulado no Ano

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	575.354,23	0,00	0,00	585.017,52	9.663,29	1,68%	1,33%	1,68%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.258.946,25	0,00	0,00	2.296.639,06	37.692,81	1,67%	1,20%	1,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.643.093,83	0,00	0,00	1.656.380,30	13.286,47	0,81%	0,44%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.344.242,78	0,00	0,00	6.389.581,58	45.338,80	0,71%	0,07%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.076.924,71	822.381,13	280.042,70	41.911.283,16	292.020,02	0,70%	0,07%	0,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	62.599,96	0,00	0,00	63.006,65	406,69	0,65%	0,01%	0,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.801.184,13	0,00	0,00	4.831.623,07	30.438,94	0,63%	0,02%	0,63%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	9.016.845,49	0,00	0,00	9.072.455,63	55.610,14	0,62%	0,02%	0,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.449,66	815.434,69	825.030,67	8.464,73	611,05	0,07%	0,01%	0,56%
Total Renda Fixa					485.068,21	0,73%	0,12%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º 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	39.559.963,74	3.000.781,97	1.711.023,03	41.911.283,16	1.061.560,48	2,60%	2,67%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.874.925,98	0,00	0,00	9.072.455,63	197.529,65	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.223.402,94	0,00	0,00	6.389.581,58	166.178,64	2,67%	2,67%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.158.435,73	0,00	0,00	2.296.639,06	138.203,33	6,40%	6,40%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.726.350,80	0,00	0,00	4.831.623,07	105.272,27	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.592.800,22	0,00	0,00	1.656.380,30	63.580,08	3,99%	3,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	554.040,98	0,00	0,00	585.017,52	30.976,54	5,59%	5,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	61.611,16	0,00	0,00	63.006,65	1.395,49	2,26%	2,27%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.634.075,12	1.626.929,47	8.464,73	1.319,08	0,16%	1,99%
Total Renda Fixa					1.766.015,56	2,74%	