

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.

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%	9.100.846,92	79,75%	50,00%	75,00%	100,00%	2.310.744,92
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.423.477,55
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	298.990,45	2,62%	0,00%	5,00%	15,00%	1.412.748,33
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	393.291,53	3,45%	0,00%	5,00%	5,00%	177.288,06
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	214.000,00	1,88%	0,00%	5,00%	5,00%	356.579,59
DF - Artigo 6º	100,00%	269.245,58	2,36%	0,00%	0,00%	0,00%	-269.245,58
Total Carteira		10.276.374,48					

RENTA FIXA	10.774.555,44	104,85%
RENTA VARIÁVEL	906.281,98	8,82%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	9.100.846,92	77,91%	50,00%	95,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	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%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	298.990,45	2,56%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	393.291,53	3,37%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	214.000,00	1,83%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	269.245,58	2,31%	0,00%	0,00%
Total	10.276.374,48	87,98%	62,00	265,00

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	1,352%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	8,09%	2,08%	8,09%	16,54%	35,39%	0,20%	1,370%	4,86%

IRF-M 1	0,886%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
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	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	5,17%	2,29%	5,17%	11,95%	26,67%	1,00%	0,013%	0,08%

IMA-B	0,164%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	5,35%	-1,39%	5,35%	13,12%	31,49%	0,20%	2,448%	9,79%

Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,71%	1,78%	5,71%	12,09%	30,65%	0,20%	0,756%	2,89%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	5,94%	4,90%	1,90%	4,90%	15,05%	35,44%	1,20%	9,780%	21,16%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,00%	6,25%	3,56%	6,25%	13,35%	28,77%	0,60%	0,716%	4,70%
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,62%	8,66%	-1,85%	8,66%	14,06%	4,57%	1,00%	5,668%	18,56%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.440.226,36	55,13%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.971.365,48	42,56%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	269.245,58	2,31%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.757.365,48	40,73%
IRF-M	2.367.842,82	20,27%
IMA-B	1.605.455,05	13,74%
CDI	1.404.462,94	12,02%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	393.291,53	3,37%
IDKA IPCA 2A	370.183,57	3,17%
DISP. FINANCEIRA	269.245,58	2,31%
FUNDO IMOBILIÁRIO	214.000,00	1,83%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	10.883.896,86	86.821,05	0,00	11.145.270,05	174.552,14	1,59%	0,89%	178,39%	1,44%
Fevereiro	11.145.270,05	258.329,00	371.714,16	11.223.874,13	191.989,24	1,72%	0,75%	230,16%	0,98%
Março	11.223.874,13	303.529,91	234.768,66	11.415.591,23	122.955,85	1,09%	0,78%	138,78%	1,20%
Abril	11.415.591,23	236.907,99	259.330,58	11.451.993,86	58.825,22	0,52%	0,56%	92,41%	0,97%
Maiο	11.451.993,86	267.587,48	218.751,53	11.545.935,98	45.106,17	0,39%	0,82%	47,74%	4,30%
Junho	11.545.935,98	694,17	237.746,28	11.411.591,84	102.707,97	0,89%	0,26%	347,98%	1,09%
Acumulado no ano					696.136,59	6,35%	4,13%	153,94%	

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(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.336.916,03	0,00	0,00	2.367.842,82	30.926,79	1,32%	1,37%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.716.560,84	0,00	0,00	4.757.365,48	40.804,64	0,87%	0,18%	0,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	850.619,19	0,00	0,00	857.541,74	6.922,55	0,81%	0,03%	0,81%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	778.572,29	694,17	237.746,28	546.921,20	5.401,02	0,69%	0,01%	0,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	367.933,78	0,00	0,00	370.183,57	2.249,79	0,61%	0,76%	0,61%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.603.101,43	0,00	0,00	1.605.455,05	2.353,62	0,15%	2,45%	0,15%
Total Renda Fixa					88.658,41	0,83%	0,79%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	202.000,00	0,00	0,00	214.000,00	12.000,00	5,94%	9,78%	5,94%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	389.381,26	0,00	0,00	393.291,53	3.910,27	1,00%	0,72%	1,00%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	300.851,16	0,00	0,00	298.990,45	-1.860,71	-0,62%	5,67%	-0,62%
Total Renda Variável					14.049,56	1,57%	4,49%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.607.430,98	27.484,83	0,00	4.757.365,48	122.449,67	2,65%	2,65%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.319.483,78	0,00	0,00	2.367.842,82	48.359,04	2,08%	2,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	836.299,40	0,00	0,00	857.541,74	21.242,34	2,54%	2,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	766.147,83	477.704,81	715.828,39	546.921,20	18.896,95	2,06%	2,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	363.723,83	0,00	0,00	370.183,57	6.459,74	1,78%	1,78%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.628.133,62	0,00	0,00	1.605.455,05	-22.678,57	-1,39%	-1,39%
Total Renda Fixa					194.729,17	1,85%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	379.758,85	0,00	0,00	393.291,53	13.532,68	3,56%	3,56%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	210.000,00	0,00	0,00	214.000,00	4.000,00	1,90%	1,90%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	304.612,94	0,00	0,00	298.990,45	-5.622,49	-1,85%	-1,85%
Total Renda Variável					11.910,19	1,33%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.243.873,91	275.521,18	30.000,00	4.757.365,48	267.970,39	6,10%	6,15%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.190.567,15	0,00	0,00	2.367.842,82	177.275,67	8,09%	8,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.523.907,71	0,00	0,00	1.605.455,05	81.547,34	5,35%	5,35%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	811.254,72	0,00	0,00	857.541,74	46.287,02	5,71%	5,71%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	914.794,14	878.348,42	1.292.311,21	546.921,20	46.089,85	4,72%	5,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	350.186,00	0,00	0,00	370.183,57	19.997,57	5,71%	5,71%
Total Renda Fixa					639.167,84	6,33%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	275.154,80	0,00	0,00	298.990,45	23.835,65	8,66%	8,66%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	370.158,43	0,00	0,00	393.291,53	23.133,10	6,25%	6,25%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	204.000,00	0,00	0,00	214.000,00	10.000,00	4,90%	4,90%
Total Renda Variável					56.968,75	6,71%	