

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.

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%	9.549.451,29	81,95%	50,00%	75,00%	100,00%	2.103.607,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.495.917,54
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	312.548,21	2,68%	0,00%	5,00%	15,00%	1.435.410,56
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	399.389,69	3,43%	0,00%	5,00%	5,00%	183.263,23
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	219.800,00	1,89%	0,00%	5,00%	5,00%	362.852,92
Total Carteira		10.481.189,19					

RENTA FIXA	10.721.320,56	102,29%
RENTA VARIÁVEL	931.737,90	8,89%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	9.549.451,29	81,95%	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	312.548,21	2,68%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	399.389,69	3,43%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	219.800,00	1,89%	0,00%	5,00%
Total	10.481.189,19	89,94%	62,00	265,00

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	3,998%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,96%	9,52%	2,86%	7,54%	14,73%	37,86%	0,20%	2,242%	9,85%
IRF-M	2,307%	10,74%	4,00%	8,27%	17,91%	37,45%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,31%	10,59%	3,92%	8,10%	17,68%	36,85%	0,20%	1,028%	4,87%
IRF-M 1	1,049%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
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	0,797%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	5,92%	2,28%	4,86%	11,57%	26,18%	1,00%	0,009%	0,09%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,44%	8,29%	3,47%	7,12%	13,62%	31,55%	0,20%	0,949%	2,92%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	4,82%	12,37%	-2,35%	3,49%	27,11%	42,43%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,53%	13,59%	2,84%	6,47%	8,14%	11,92%	1,00%	3,996%	18,39%
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,55%	7,90%	3,78%	8,03%	13,32%	29,71%	0,60%	1,039%	4,73%
IFIX	-0,39%	10,84%	1,52%	6,83%	19,08%	40,54%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,71%	7,75%	8,28%	6,70%	13,42%	9,91%	1,20%	14,033%	22,50%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.354.428,26	54,53%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.298.630,20	45,47%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	5.078.830,20	43,58%
IRF-M	2.422.444,12	20,79%
IMA-B	1.668.977,89	14,32%
CDI	1.171.869,27	10,06%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	399.389,69	3,43%
IDKA IPCA 2A	379.199,08	3,25%
FUNDO IMOBILIÁRIO	219.800,00	1,89%

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	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%
Julho	11.411.591,84	270.283,25	244.188,51	11.653.058,46	215.371,88	1,88%	0,73%	258,68%	1,06%
Acumulado no ano					911.508,47	8,36%	4,89%	171,05%	

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.605.455,05	0,00	0,00	1.668.977,89	63.522,84	3,96%	2,24%	3,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	370.183,57	0,00	0,00	379.199,08	9.015,51	2,44%	0,95%	2,44%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.367.842,82	0,00	0,00	2.422.444,12	54.601,30	2,31%	1,03%	2,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.757.365,48	269.245,58	0,00	5.078.830,20	52.219,14	1,04%	0,20%	1,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	857.541,74	0,00	0,00	864.450,44	6.908,70	0,81%	0,01%	0,81%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	546.921,20	1.037,67	244.188,51	307.418,83	3.648,47	0,67%	0,01%	0,71%
Total Renda Fixa					189.915,96	1,80%	0,71%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	298.990,45	0,00	0,00	312.548,21	13.557,76	4,53%	4,00%	4,53%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	214.000,00	0,00	0,00	219.800,00	5.800,00	2,71%	14,03%	2,71%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	393.291,53	0,00	0,00	399.389,69	6.098,16	1,55%	1,04%	1,55%
Total Renda Variável					25.455,92	2,81%	5,10%	