

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.228.436,17	84,38%	50,00%	75,00%	100,00%	1.893.703,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.636.641,87
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	326.773,97	2,70%	0,00%	5,00%	15,00%	1.491.546,97
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	402.708,60	3,32%	0,00%	5,00%	5,00%	203.398,38
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	203.800,00	1,68%	0,00%	5,00%	5,00%	402.306,98
DF - Artigo 6º	100,00%	839,70	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	-839,70
Total Carteira		11.162.558,44					

RENTA FIXA	11.189.696,70	100,24%
RENTA VARIÁVEL	933.282,57	8,36%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.228.436,17	84,37%	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	326.773,97	2,70%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	402.708,60	3,32%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	203.800,00	1,68%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	839,70	0,01%	0,00%	0,00%
Total	11.162.558,44	92,08%	62,00	265,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,343%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	10,97%	5,49%	4,92%	15,22%	44,11%	0,20%	1,808%	9,85%
IRF-M	1,057%	11,91%	4,79%	7,25%	18,00%	40,09%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	11,73%	4,73%	7,08%	17,74%	39,52%	0,20%	0,975%	4,87%
IRF-M 1	0,901%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
CDI	0,801%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	7,40%	2,43%	5,30%	12,17%	27,88%	0,20%	0,003%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	6,96%	20,19%	10,75%	3,45%	33,46%	71,33%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,55%	18,76%	8,62%	6,04%	14,67%	30,19%	1,00%	5,647%	18,33%
IFIX	0,87%	11,80%	1,36%	2,76%	17,94%	42,94%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-7,28%	-0,10%	0,89%	-5,65%	2,56%	22,77%	1,20%	12,124%	22,33%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	8,79%	3,42%	8,98%	12,88%	29,24%	0,60%	0,302%	4,71%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.211.455,62	51,24%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.910.683,95	48,76%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	839,70	0,01%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	5.706.883,95	47,07%
IRF-M	2.447.568,94	20,19%
IMA-B	1.691.051,68	13,95%
CDI	960.420,83	7,92%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	402.708,60	3,32%
IDKA IPCA 2A	382.931,60	3,16%
FUNDO IMOBILIÁRIO	203.800,00	1,68%
DISP. FINANCEIRA	839,70	0,01%

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%
Agosto	11.653.058,46	594.802,94	233.189,02	12.122.139,57	107.467,19	0,89%	0,72%	123,50%	0,87%
Acumulado no ano					1.018.975,66	9,33%	5,65%	165,20%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	1.668.977,89	0,00	0,00	1.691.051,68	22.073,79	1,32%	1,81%	1,32%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.422.444,12	0,00	0,00	2.447.568,94	25.124,82	1,04%	0,98%	1,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	379.199,08	0,00	0,00	382.931,60	3.732,52	0,98%	0,49%	0,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.078.830,20	582.000,00	0,00	5.706.883,95	46.053,75	0,81%	0,08%	0,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	864.450,44	0,00	0,00	871.304,76	6.854,32	0,79%	0,00%	0,79%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	307.418,83	12.802,94	233.189,02	89.116,07	2.083,32	0,65%	0,00%	0,70%
Total Renda Fixa					105.922,52	0,96%	0,54%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	312.548,21	0,00	0,00	326.773,97	14.225,76	4,55%	5,65%	4,55%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	399.389,69	0,00	0,00	402.708,60	3.318,91	0,83%	0,30%	0,83%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	219.800,00	0,00	0,00	203.800,00	-16.000,00	-7,28%	12,12%	-7,28%
Total Renda Variável					1.544,67	0,17%	4,76%	