

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.

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%	10.338.202,24	84,00%	50,00%	75,00%	100,00%	1.968.792,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.692.098,53
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	336.870,48	2,74%	0,00%	5,00%	15,00%	1.509.178,78
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	405.776,46	3,30%	0,00%	5,00%	5,00%	209.573,29
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	219.994,00	1,79%	0,00%	5,00%	5,00%	395.355,75
DF - Artigo 6º	100,00%	2.297,70	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.297,70
Total Carteira		11.303.140,88					

RENTA FIXA	11.346.651,85	100,38%
RENTA VARIÁVEL	962.640,94	8,52%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.338.202,24	83,99%	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	336.870,48	2,74%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	405.776,46	3,30%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	219.994,00	1,79%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	2.297,70	0,02%	0,00%	0,00%
Total	11.303.140,88	91,83%	62,00	265,00

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	1,811%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	12,94%	7,21%	5,71%	15,46%	47,78%	0,20%	1,328%	9,80%
IRF-M	1,479%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	13,36%	4,87%	7,06%	17,16%	43,01%	0,20%	1,005%	4,84%
IRF-M 1	0,745%	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%
CDI	0,638%	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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,26%	1,99%	4,33%	10,54%	25,16%	1,00%	0,013%	0,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	10,29%	4,33%	6,18%	12,73%	33,31%	0,20%	0,476%	2,90%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,95%	7,84%	2,80%	4,76%	11,22%	39,24%	1,20%	11,303%	22,79%
IDIV	6,12%	27,55%	18,99%	11,86%	42,02%	93,80%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,09%	22,43%	12,67%	10,59%	20,62%	43,78%	1,00%	6,002%	17,84%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	9,62%	3,17%	6,85%	12,13%	28,70%	0,60%	2,419%	4,86%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.339.333,17	51,50%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.967.661,92	48,48%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.297,70	0,02%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	5.747.667,92	46,69%
IRF-M	2.483.155,22	20,17%
IMA-B	1.721.165,32	13,98%
CDI	1.006.151,91	8,17%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	405.776,46	3,30%
IDKA IPCA 2A	386.213,78	3,14%
FUNDO IMOBILIÁRIO	219.994,00	1,79%
DISP. FINANCEIRA	2.297,70	0,02%

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%
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%
Setembro	12.122.139,57	261.996,28	223.063,50	12.306.995,09	145.922,74	1,20%	0,62%	192,21%	0,88%
Acumulado no ano					1.164.898,40	10,64%	6,30%	168,73%	

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.691.051,68	0,00	0,00	1.721.165,32	30.113,64	1,78%	1,33%	1,78%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.447.568,94	0,00	0,00	2.483.155,22	35.586,28	1,45%	1,00%	1,45%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	382.931,60	0,00	0,00	386.213,78	3.282,18	0,86%	0,48%	0,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.706.883,95	0,00	0,00	5.747.667,92	40.783,97	0,71%	0,07%	0,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	871.304,76	0,00	0,00	876.965,10	5.660,34	0,65%	0,01%	0,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	89.116,07	261.996,28	223.063,50	129.186,81	1.137,96	0,32%	0,01%	0,56%
Total Renda Fixa					116.564,37	1,04%	0,48%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	203.800,00	0,00	0,00	219.994,00	16.194,00	7,95%	11,30%	7,95%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	326.773,97	0,00	0,00	336.870,48	10.096,51	3,09%	6,00%	3,09%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	402.708,60	0,00	0,00	405.776,46	3.067,86	0,76%	2,42%	0,76%
Total Renda Variável					29.358,37	3,15%	5,70%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.757.365,48	851.245,58	0,00	5.747.667,92	139.056,86	2,59%	2,67%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.605.455,05	0,00	0,00	1.721.165,32	115.710,27	7,21%	7,21%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.367.842,82	0,00	0,00	2.483.155,22	115.312,40	4,87%	4,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	857.541,74	0,00	0,00	876.965,10	19.423,36	2,27%	2,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	370.183,57	0,00	0,00	386.213,78	16.030,21	4,33%	4,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	546.921,20	275.836,89	700.441,03	129.186,81	6.869,75	1,65%	1,99%
Total Renda Fixa					412.402,85	3,84%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	298.990,45	0,00	0,00	336.870,48	37.880,03	12,67%	12,67%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	393.291,53	0,00	0,00	405.776,46	12.484,93	3,17%	3,17%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	214.000,00	0,00	0,00	219.994,00	5.994,00	2,80%	2,80%
Total Renda Variável					56.358,96	6,22%	