

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.

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 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	13.101.411,62	14,45%	1.197	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.462.482,75	9,33%	594	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.325.035,30	15,80%	605	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	452.477,23	0,50%	686	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.711.349,62	8,51%	281	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.598.704,44	2,87%	292	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.447.574,12	11,52%	706	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.048.000,67	7,77%	703	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	167.524,69	0,18%	202	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	599.253,78	0,66%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.091.527,46	13,34%	1.367	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.184.242,26	2,41%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.721.382,77	10,72%	739	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	586.589,80	0,65%	222	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	13.727,67	0,02%	213	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.145.580,01	1,26%	620	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV
Total			90.656.864,19				

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%	89.497.556,51	98,72%	30,00%	35,00%	70,00%	-26.037.751,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	54.394.118,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	27.197.059,26
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.598.529,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.532.843,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.532.843,21
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.598.529,63
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.532.843,21
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.532.843,21
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.532.843,21
Total Carteira		89.497.556,51					

RENTA FIXA	90.656.864,19	101,30%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	89.497.556,51	98,72%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	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 III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	89.497.556,51	98,72%	66,00	215,00

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 5+	4,674%	10,43%	2,76%	8,01%	15,89%	42,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,61%	10,26%	2,79%	7,91%	15,61%	41,52%	0,20%	2,937%	12,75%
IMA-B	3,998%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,97%	9,54%	2,89%	7,56%	14,82%	36,75%	0,20%	2,253%	9,84%
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%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,66%	4,27%	2,95%	3,23%	6,22%	15,38%	0,20%	0,658%	4,51%
IMA-B 5	2,846%	8,47%	3,47%	7,23%	13,72%	32,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,82%	8,37%	3,44%	7,15%	13,53%	31,44%	0,20%	1,220%	3,64%
IDKA IPCA 2 Anos	2,527%	9,07%	3,80%	7,90%	14,69%	32,93%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,41%	8,28%	3,48%	7,14%	13,54%	31,73%	0,20%	0,943%	2,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	7,21%	2,94%	6,14%	11,83%	29,50%	0,20%	0,649%	1,92%
IMA Geral	2,339%	9,05%	3,19%	7,11%	14,99%	34,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,30%	9,00%	3,22%	7,12%	15,17%	34,15%	0,20%	1,022%	4,79%
IRF-M	2,307%	10,74%	4,00%	8,27%	17,91%	37,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,31%	10,63%	4,00%	8,14%	17,77%	36,78%	0,20%	1,022%	4,89%
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%

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
IRF-M 1	1,049%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,23%	2,83%	5,89%	13,20%	29,51%	0,10%	0,212%	0,67%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,73%	6,00%	2,34%	4,93%	11,60%	26,18%	0,80%	0,008%	0,08%
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%
IPCA	0,240%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,53%	8,48%	3,33%	7,27%	13,36%	31,25%	0,20%	1,028%	3,60%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.401.289,87	53,39%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.255.574,32	46,61%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	25.192.939,08	27,79%
IMA-B	24.046.418,07	26,52%
IDKA IPCA 2A	19.509.310,65	21,52%
IRF-M	8.163.826,85	9,01%
IMA-B 5	7.634.590,47	8,42%
IMA-B 5+	2.598.704,44	2,87%
IPCA	2.184.242,26	2,41%
CDI	1.159.307,68	1,28%
IMA-GERAL	167.524,69	0,18%

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	82.463.526,96	9.478,48	627.121,88	83.039.727,09	1.193.843,53	1,45%	0,89%	162,31%	1,63%
Fevereiro	83.039.727,09	26.094.947,59	25.631.156,13	85.660.017,26	2.156.498,71	2,58%	0,75%	345,05%	1,58%
Março	85.660.017,26	1.296.933,66	772.248,09	87.159.623,33	974.920,50	1,13%	0,78%	144,18%	1,73%
Abril	87.159.623,33	2.308.994,59	1.798.542,48	87.622.942,08	-47.133,36	-0,05%	0,56%	-9,64%	1,57%
Mai	87.622.942,08	45.902.418,89	44.735.839,92	87.824.300,02	-965.221,03	-1,09%	0,82%	-132,32%	10,69%
Junho	87.824.300,02	1.724.613,17	872.960,73	88.972.379,02	296.426,56	0,33%	0,26%	130,76%	2,02%
Julho	88.972.379,02	37.712.917,14	38.685.306,38	90.656.864,19	2.656.874,41	2,99%	0,73%	410,23%	1,16%
Acumulado no ano					6.266.209,32	7,51%	4,89%	153,71%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.349.921,84	0,00	0,00	9.721.382,77	371.460,93	3,97%	2,25%	3,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.779.811,23	0,00	0,00	14.325.035,30	545.224,07	3,96%	2,24%	3,96%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.838.382,01	0,00	13.263.390,33	0,00	425.008,32	3,31%	2,97%	4,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.854.484,64	0,00	0,00	7.048.000,67	193.516,03	2,82%	1,22%	2,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.130.427,57	0,00	0,00	2.184.242,26	53.814,69	2,53%	1,03%	2,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.199.181,61	0,00	0,00	10.447.574,12	248.392,51	2,44%	0,95%	2,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.372.842,56	0,00	110.000,00	8.462.482,75	199.640,19	2,38%	0,94%	2,41%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.536.940,94	0,00	0,00	7.711.349,62	174.408,68	2,31%	1,02%	2,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	442.278,49	0,00	0,00	452.477,23	10.198,74	2,31%	1,03%	2,31%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	163.758,71	0,00	0,00	167.524,69	3.765,98	2,30%	1,02%	2,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.295.965,10	0,00	12.000.000,00	2.598.704,44	302.739,34	2,12%	2,94%	4,61%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	577.036,67	0,00	0,00	586.589,80	9.553,13	1,66%	0,66%	1,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	589.572,92	0,00	0,00	599.253,78	9.680,86	1,64%	0,65%	1,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	40.648,05	12.000.000,00	12.911,95	12.091.527,46	63.791,36	0,53%	0,20%	1,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.624.549,46	707.804,64	1.196.985,47	1.145.580,01	10.211,38	0,44%	0,01%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	175.718,54	12.894.522,87	0,00	13.101.411,62	31.170,21	0,24%	0,21%	1,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	858,68	12.110.589,63	12.102.018,63	13.727,67	4.297,99	0,04%	0,01%	0,73%
Total Renda Fixa					2.656.874,41	2,99%	1,16%	