

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.857.229,56	16,84%	613	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	596.769,88	0,63%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.122.246,12	1,19%	602	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.145.129,97	10,77%	713	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.969.529,30	13,77%	712	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.679,93	0,00%	226	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.250,61	0,01%	545	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	584.513,50	0,62%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.244.325,58	16,19%	1.401	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	15.030.545,61	15,96%	1.230	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.298.004,34	8,81%	236	2,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.179.340,95	2,31%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	120.056,65	0,13%	677	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	71.188,03	0,08%	748	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	171.554,70	0,18%	199	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.221.352,01	9,79%	644	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.310,49	0,00%	295	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	784.882,68	0,83%	28	1,03%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	939.538,60	1,00%	6.129	1,10%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	808.078,49	0,86%	121	0,36%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
Total			94.155.527,00				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (novembro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	35,00%	70,00%	65.908.868,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	56.493.316,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	91.623.027,23	97,31%	5,00%	5,00%	30,00%	-63.376.369,13
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	14.123.329,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.707.776,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.707.776,35
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	2.532.499,77	2,69%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.532.499,77
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	14.123.329,05
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.707.776,35
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.707.776,35
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.707.776,35
Total Carteira		94.155.527,00					

RENDA FIXA	91.623.027,23	97,31%
RENDA VARIÁVEL	2.532.499,77	2,69%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	91.623.027,23	97,31%	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 I, Alínea ' a '	2.532.499,77	2,69%	0,00%	0,00%
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	94.155.527,00	100,00%	66,00	215,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	50.375.936,10	53,50%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.179.379,12	44,80%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	815.329,10	0,87%	0,00%
META ASSET MANAGEMENT	784.882,68	0,83%	0,97%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '900000' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rf.asp, line 55