

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.

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.901.160,82	8,44%	303	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.286.281,70	13,12%	1.382	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	589.592,00	0,63%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	171.416,76	0,18%	205	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.206.141,79	7,69%	711	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.240.967,32	12,00%	601	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	577.458,61	0,62%	222	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.163.811,17	2,31%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.915.595,25	14,86%	1.221	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.854.641,56	11,59%	701	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.027.667,44	10,71%	771	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	463.817,18	0,50%	696	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	55.250,18	0,06%	259	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.772.966,21	15,77%	613	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	283.358,84	0,30%	229	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	149.372,95	0,16%	642	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	506.509,45	0,54%	536	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	251.220,46	0,27%	22	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
BRANCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	250.025,83	0,27%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
Total			93.667.255,52				

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%	92.226.767,99	98,46%	30,00%	35,00%	70,00%	-26.659.689,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	56.200.353,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	939.241,24	1,00%	5,00%	5,00%	30,00%	27.160.935,42
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	14.050.088,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.683.362,78
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.683.362,78
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	501.246,29	0,54%	5,00%	10,00%	15,00%	13.548.842,04
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.683.362,78
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.683.362,78
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.683.362,78
Total Carteira		93.667.255,52					

RENTA FIXA	93.166.009,23	99,46%
RENTA VARIÁVEL	501.246,29	0,54%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	92.226.767,99	98,46%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	939.241,24	1,00%	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	501.246,29	0,54%	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	93.667.255,52	100,00%	66,00	215,00

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 5+	2,40%	14,62%	8,64%	5,79%	17,29%	57,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	14,38%	8,52%	5,75%	16,99%	56,58%	0,20%	2,004%	12,71%

IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	12,99%	7,25%	5,77%	15,63%	47,62%	0,20%	1,346%	9,79%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	10,51%	4,45%	5,97%	12,92%	33,75%	0,20%	0,487%	3,55%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,65%	0,07%	2,15%	4,86%	17,80%	0,20%	0,279%	4,41%

IRF-M	1,48%	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%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	13,36%	4,83%	7,06%	17,22%	43,02%	0,20%	1,010%	4,86%

IMA Geral	1,33%	11,68%	4,82%	5,99%	14,81%	40,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	11,53%	4,68%	5,95%	14,83%	39,64%	0,20%	0,749%	4,75%

IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%

IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	10,30%	4,32%	6,24%	12,77%	33,38%	0,20%	0,491%	2,83%
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 Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	8,48%	2,84%	4,98%	10,90%	28,86%	0,20%	0,276%	1,89%
IRF-M 1	0,74%	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%
Selic	0,64%	8,04%	2,26%	4,86%	11,54%	27,33%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,67%	8,46%	2,49%	5,25%	12,20%	28,08%	0,20%	0,006%	0,13%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,57%	7,38%	2,04%	4,43%	10,63%	25,21%	0,80%	0,012%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,26%	1,99%	4,33%	10,54%	25,16%	1,00%	0,013%	0,11%

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
IBX	4,69%	24,29%	17,91%	14,93%	27,43%	62,93%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	8,11%	38,16%	26,57%	22,59%	46,55%	83,68%	2,50%	7,184%	24,81%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2,64%	35,22%	16,57%	18,76%	34,23%	74,32%	1,50%	6,763%	18,35%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	49.749.703,46	53,11%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.909.796,32	45,81%
BANCO BRADESCO	506.509,45	0,54%
BANCO DAYCOVAL	251.220,46	0,27%
BEM DTVM	250.025,83	0,27%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	26.964.444,82	28,79%
IRF-M 1	26.201.876,95	27,97%
IDKA IPCA 2A	22.685.200,88	24,22%
IRF-M	8.364.978,00	8,93%
IMA-B 5	7.783.600,40	8,31%
CDI	939.241,24	1,00%
AÇÕES - VALOR	251.220,46	0,27%
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	250.025,83	0,27%
IMA-GERAL	171.416,76	0,18%
IMA-B 5+	55.250,18	0,06%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.850.374,59	0,00	0,00	10.027.667,44	177.292,85	1,80%	1,35%	1,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.514.497,26	0,00	0,00	14.772.966,21	258.468,95	1,78%	1,33%	1,78%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	457.170,17	0,00	0,00	463.817,18	6.647,01	1,45%	1,00%	1,45%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.789.001,68	0,00	0,00	7.901.160,82	112.159,14	1,44%	1,01%	1,44%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	169.246,21	0,00	0,00	171.416,76	2.170,55	1,28%	0,75%	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.135.370,86	0,00	0,00	7.206.141,79	70.770,93	0,99%	0,65%	0,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.145.030,67	0,00	0,00	2.163.811,17	18.780,50	0,88%	0,49%	0,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.544.059,37	2.600.000,00	0,00	11.240.967,32	96.907,95	0,87%	0,49%	0,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.550.411,39	212.000,00	0,00	10.854.641,56	92.230,17	0,86%	0,48%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.633.273,85	0,00	2.600.000,00	55.250,18	21.976,33	0,83%	2,00%	2,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.199.101,48	0,00	0,00	12.286.281,70	87.180,22	0,71%	0,07%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.216.373,07	800.000,00	200.000,00	13.915.595,25	99.222,18	0,71%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	574.589,23	0,00	0,00	577.458,61	2.869,38	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	586.664,35	0,00	0,00	589.592,00	2.927,65	0,50%	0,28%	0,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.505.317,77	426.753,05	1.786.215,35	149.372,95	3.517,48	0,18%	0,01%	0,56%
BRAPRECO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.005.000,00	500.000,00	506.509,45	1.509,45	0,15%	0,01%	0,67%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	46.924,03	3.957.968,98	3.725.811,29	283.358,84	4.277,12	0,11%	0,01%	0,57%
Total Renda Fixa					1.058.907,86	1,15%	0,65%	

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(%)
META VALOR FI AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	251.220,46	1.220,46	0,49%	7,18%	8,11%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	250.025,83	25,83	0,01%	6,76%	2,64%
Total Renda Variável					1.246,29	0,25%	6,97%	

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 (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.779.811,23	0,00	0,00	14.772.966,21	993.154,98	7,21%	7,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.349.921,84	0,00	0,00	10.027.667,44	677.745,60	7,25%	7,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.199.181,61	212.000,00	0,00	10.854.641,56	443.459,95	4,33%	4,33%
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%	8,56%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.372.842,56	2.600.000,00	110.000,00	11.240.967,32	378.124,76	4,27%	4,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.536.940,94	0,00	0,00	7.901.160,82	364.219,88	4,83%	4,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.295.965,10	0,00	14.600.000,00	55.250,18	359.285,08	4,34%	8,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.854.484,64	0,00	0,00	7.206.141,79	351.657,15	5,13%	5,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	40.648,05	12.000.000,00	12.911,95	12.286.281,70	258.545,60	2,15%	2,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	175.718,54	13.694.522,87	200.000,00	13.915.595,25	245.353,84	1,83%	2,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.130.427,57	0,00	60.483,66	2.163.811,17	93.867,26	4,43%	4,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.624.549,46	2.173.689,87	3.674.547,86	149.372,95	25.681,48	1,17%	1,99%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	442.278,49	0,00	0,00	463.817,18	21.538,69	4,87%	4,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	589.572,92	0,00	16.610,03	589.592,00	16.629,11	2,83%	2,84%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	577.036,67	0,00	15.948,41	577.458,61	16.370,35	2,85%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	858,68	16.223.040,74	15.949.582,06	283.358,84	9.041,48	0,42%	2,04%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	163.758,71	0,00	0,00	171.416,76	7.658,05	4,68%	4,68%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.005.000,00	500.000,00	506.509,45	1.509,45	0,15%	2,49%
Total Renda Fixa					4.688.851,03	5,28%	

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 (%)
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	0,00	200.000,00	212.349,27	0,00	12.349,27	6,17%	15,02%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	251.220,46	1.220,46	0,49%	26,57%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	250.025,83	25,83	0,01%	16,57%
Total Renda Variável					13.595,56	Microsoft VBScript runtime error '800a000b'	

Division by zero

/plataforma/relatorios/uRetornoTriRV.asp, line 136