

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 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 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	516.359,27	0,50%	178	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.323.078,09	19,69%	1.197	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	51.606.623,02	50,01%	1.360	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	D+67 a D+1464	Não há	6.051.530,02	5,86%	3	27,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	6.602.791,81	6,40%	774	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.290.589,54	1,25%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.550.286,59	1,50%	615	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	934.677,80	0,91%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.801.912,19	3,68%		22,29%	Artigo 8º, Inciso VI
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	7.035.729,79	6,82%	6	27,64%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			99.713.578,12				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.488.428,10				Artigo 6º
Total			103.202.006,22				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	72.446.060,38	72,65%	50,00%	70,00%	100,00%	27.267.517,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	6.051.530,02	6,07%	0,00%	0,00%	60,00%	53.776.616,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	9.443.667,94	9,47%	5,00%	10,00%	30,00%	20.470.405,50
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	14.957.036,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.985.678,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	934.677,80	0,94%	0,00%	2,50%	5,00%	4.051.001,11
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.985.678,91
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.801.912,19	3,81%	0,00%	5,00%	5,00%	1.183.766,72
Desenquadrado - RF	0,00%	7.035.729,79	7,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.035.729,79
DF - Artigo 6º	100,00%	3.488.428,10	3,50%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.488.428,10
Total Carteira		103.202.006,22					

RENDA FIXA	99.400.094,03	96,32%
RENDA VARIÁVEL	3.801.912,19	3,68%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	72.446.060,38	70,20%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	6.051.530,02	5,86%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	9.443.667,94	9,15%	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 '	934.677,80	0,91%	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	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%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.801.912,19	3,68%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	7.035.729,79	6,82%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	3.488.428,10	3,38%	0,00%	0,00%
Total	103.202.006,22	100,00%	67,00	270,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	8,81%	1,92%	8,81%	17,98%	38,93%	0,20%	1,814%	6,47%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	6,11%	2,63%	6,11%	13,17%	29,76%	0,10%	0,182%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	5,17%	2,29%	5,17%	11,95%	26,67%	1,00%	0,013%	0,08%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	0,36%	-	-0,20%	-	-	-	1,20%	1,132%	9,89%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,35%	4,05%	0,92%	4,05%	-	-	0,90%	1,040%	-
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,62%	5,21%	2,01%	5,21%	10,79%	29,94%	0,20%	0,382%	1,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	4,48%	1,94%	4,48%	9,59%	26,82%	0,20%	0,228%	0,27%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	-	-	-	-	-	-	1,80%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.057.660,09	51,41%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.766.746,03	28,84%
RJI CORRETORA DE VALORES	13.087.259,81	12,68%
Planner Corretora	3.801.912,19	3,68%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.488.428,10	3,38%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	71.929.701,11	69,70%
IMA-B	13.087.259,81	12,68%
CDI	8.153.078,40	7,90%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.801.912,19	3,68%
DISP. FINANCEIRA	3.488.428,10	3,38%
IMA-B 5	1.290.589,54	1,25%
CRÉDITO PRIVADO	934.677,80	0,91%
IRF-M 1+	516.359,27	0,50%

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	79.513.976,61	7.195.676,69	0,00	87.664.986,82	955.333,52	1,10%	0,89%	123,53%	0,26%
Fevereiro	87.664.986,82	113.647,81	1.620.018,05	86.977.912,77	819.296,19	0,93%	0,75%	124,87%	0,08%
Março	86.977.912,77	0,00	1.533.922,89	86.355.649,26	911.659,38	1,05%	0,78%	133,60%	0,12%
Abril	86.355.649,26	10.363.686,69	6.721.645,17	90.713.809,11	716.118,33	0,80%	0,56%	142,69%	0,17%
Mai	90.713.809,11	5.114.852,71	1.935.296,28	94.652.475,28	759.109,74	0,81%	0,82%	98,41%	1,03%
Junho	94.652.475,28	13.451.200,00	14.069.984,51	94.782.443,81	748.753,04	0,79%	0,26%	309,45%	0,30%
Acumulado no ano					4.910.270,20	5,61%	4,13%	135,81%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	508.784,58	0,00	0,00	516.359,27	7.574,69	1,49%	1,81%	1,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	51.163.984,75	0,00	0,00	51.606.623,02	442.638,27	0,87%	0,18%	0,87%
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	0,00	6.000.000,00	0,00	6.051.530,02	51.530,02	0,86%	1,13%	0,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.460.424,90	0,00	8.314.819,04	20.323.078,09	177.472,23	0,62%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	928.944,80	0,00	0,00	934.677,80	5.733,00	0,62%	0,38%	0,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.048.718,87	4.000.682,36	1.495.809,50	6.602.791,81	49.200,08	0,61%	0,03%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.284.521,79	0,00	0,00	1.290.589,54	6.067,75	0,47%	0,23%	0,47%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	5.005.237,16	2.000.000,00	0,00	7.035.729,79	30.492,63	0,44%	1,04%	0,35%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.257.715,29	1.542.240,85	4.259.355,97	1.550.286,59	9.686,42	0,17%	0,01%	0,73%
Total Renda Fixa					780.395,09	0,82%	0,30%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.792.489,70	0,00	0,00	3.801.912,19	9.422,49	0,25%	-	0,25%
Total Renda Variável					9.422,49	0,25%	0,00%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º 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	50.273.352,91	0,00	0,00	51.606.623,02	1.333.270,11	2,65%	2,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.592.822,96	5.067.514,52	9.995.717,37	20.323.078,09	658.457,98	2,31%	2,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.881.900,02	7.886.764,80	3.259.755,11	6.602.791,81	93.882,10	1,80%	2,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.902.112,70	3.358.541,34	9.797.965,86	1.550.286,59	87.598,41	1,45%	2,29%
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	0,00	6.000.000,00	0,00	6.051.530,02	51.530,02	0,86%	-0,20%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	7.000.000,00	0,00	7.035.729,79	35.729,79	0,54%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.266.072,76	0,00	0,00	1.290.589,54	24.516,78	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	916.220,20	0,00	0,00	934.677,80	18.457,60	2,01%	2,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	512.409,58	0,00	516.359,27	3.949,69	0,77%	1,92%
Total Renda Fixa					2.307.392,48	2,48%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.765.270,25	0,00	0,00	3.801.912,19	36.641,94	0,97%	-
				Total Renda Variável	36.641,94	0,97%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 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	48.617.865,31	0,00	0,00	51.606.623,02	2.988.757,71	6,15%	6,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.966.704,22	11.053.495,83	12.128.103,60	20.323.078,09	1.430.981,64	5,43%	6,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.075.049,87	4.072.788,39	9.896.817,87	1.550.286,59	299.266,20	4,21%	5,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.679.019,34	9.095.983,61	4.334.017,60	6.602.791,81	161.806,46	4,24%	5,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,16	0,00	35.975,08	1.290.589,54	55.765,46	4,47%	4,48%
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	0,00	6.000.000,00	0,00	6.051.530,02	51.530,02	0,86%	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	888.370,70	0,00	0,00	934.677,80	46.307,10	5,21%	5,21%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	7.000.000,00	0,00	7.035.729,79	35.729,79	0,54%	4,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	512.409,58	0,00	516.359,27	3.949,69	0,77%	8,81%
Total Renda Fixa					5.074.094,07	5,75%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.714.615,49	0,00	0,00	3.801.912,19	87.296,70	2,35%	-
				Total Renda Variável	87.296,70	2,35%	