

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	530.664,21	0,50%	185	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.438.850,05	20,31%	1.197	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	52.144.755,67	49,40%	1.367	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	D+67 a D+1464	Não há	6.169.910,57	5,84%	4	19,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.886.013,02	2,73%	620	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	7.895.329,16	7,48%	772	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.295.652,01	1,23%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	946.876,70	0,90%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.800.719,26	3,60%		17,04%	Artigo 8º, Inciso VI
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	7.165.775,01	6,79%	6	27,64%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			104.274.545,66				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.288.418,97				Artigo 6º
Total			105.562.964,63				

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%	74.114.269,93	71,08%	50,00%	70,00%	100,00%	30.160.275,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	6.169.910,57	5,92%	0,00%	0,00%	60,00%	56.394.816,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	12.076.994,19	11,58%	5,00%	10,00%	30,00%	19.205.369,51
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	15.641.181,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	5.213.727,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	946.876,70	0,91%	0,00%	2,50%	5,00%	4.266.850,58
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.213.727,28
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.800.719,26	3,64%	0,00%	5,00%	5,00%	1.413.008,02
Desenquadrado - RF	0,00%	7.165.775,01	6,87%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.165.775,01
DF - Artigo 6º	100,00%	1.288.418,97	1,24%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.288.418,97
Total Carteira		105.562.964,63					

RENDA FIXA	101.762.245,37	96,40%
RENDA VARIÁVEL	3.800.719,26	3,60%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	74.114.269,93	70,21%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	6.169.910,57	5,84%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	12.076.994,19	11,44%	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 '	946.876,70	0,90%	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	3.800.719,26	3,60%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	7.165.775,01	6,79%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	1.288.418,97	1,22%	0,00%	0,00%
Total	105.562.964,63	100,00%	67,00	270,00

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	4,00%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	1,96%	-	2,41%	-	-	-	1,20%	0,908%	9,65%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	1,85%	5,97%	2,31%	4,96%	-	-	0,90%	0,860%	-
IRF-M 1+	2,76%	11,98%	4,41%	9,07%	19,64%	41,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,77%	11,82%	4,40%	8,89%	19,48%	41,17%	0,20%	1,341%	6,47%
IRF-M 1	1,05%	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	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	6,56%	2,56%	5,40%	12,68%	28,28%	0,20%	0,007%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	5,92%	2,28%	4,86%	11,57%	26,18%	1,00%	0,009%	0,09%
IPCA	0,24%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,31%	6,59%	2,61%	5,60%	11,83%	30,36%	0,20%	0,474%	1,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	4,89%	1,71%	3,94%	9,07%	25,75%	0,20%	0,100%	0,29%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.622.296,58	50,80%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.515.844,24	31,75%
RJI CORRETORA DE VALORES	13.335.685,58	12,63%
Planner Corretora	3.800.719,26	3,60%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.288.418,97	1,22%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	73.583.605,72	69,71%
IMA-B	13.335.685,58	12,63%
CDI	10.781.342,18	10,21%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.800.719,26	3,60%
IMA-B 5	1.295.652,01	1,23%
DISP. FINANCEIRA	1.288.418,97	1,22%
CRÉDITO PRIVADO	946.876,70	0,90%
IRF-M 1+	530.664,21	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%
Julho	94.782.443,81	4.947.760,98	1.600.000,00	99.181.080,04	1.050.875,25	1,07%	0,73%	147,12%	0,28%
Acumulado no ano					5.961.145,45	6,74%	4,89%	137,89%	

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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	516.359,27	0,00	0,00	530.664,21	14.304,94	2,77%	1,34%	2,77%
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	6.051.530,02	0,00	0,00	6.169.910,57	118.380,55	1,96%	0,91%	1,96%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	7.035.729,79	0,00	0,00	7.165.775,01	130.045,22	1,85%	0,86%	1,85%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	934.677,80	0,00	0,00	946.876,70	12.198,90	1,31%	0,47%	1,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	51.606.623,02	0,00	0,00	52.144.755,67	538.132,65	1,04%	0,20%	1,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.323.078,09	2.508.568,94	1.600.000,00	21.438.850,05	207.203,02	0,91%	0,21%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.602.791,81	1.299.862,85	65.000,00	7.895.329,16	57.674,50	0,73%	0,01%	0,81%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.550.286,59	1.339.329,19	20.000,00	2.886.013,02	16.397,24	0,57%	0,01%	0,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.290.589,54	0,00	0,00	1.295.652,01	5.062,47	0,39%	0,10%	0,39%
Total Renda Fixa					1.099.399,49	1,11%	0,28%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.801.912,19	0,00	0,00	3.800.719,26	-1.192,93	-0,03%	-	1,09%
Total Renda Variável					-1.192,93	-0,03%	0,00%	