

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 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	3.855.375,53	3,58%	1.211	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	72.734.408,95	67,45%	1.381	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	536.222,95	0,50%	195	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	D+67 a D+1464	Não há	6.222.391,27	5,77%	5	14,96%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.271.313,80	1,18%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	1.008.714,09	0,94%	16	1,74%	Artigo 7º, Inciso VI
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	Não se aplica	Não se aplica	4.003.977,66	3,71%	4	29,96%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	952.370,30	0,88%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.862.904,99	3,58%		17,24%	Artigo 8º, Inciso VI
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	7.220.323,73	6,70%	7	19,91%	Desenquadrado - RF
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>101.668.003,27</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.170.549,17				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>107.838.552,44</b>				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	77.126.007,43	75,86%	50,00%	70,00%	100,00%	24.541.995,84
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	6.222.391,27	6,12%	0,00%	0,00%	60,00%	54.778.410,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	1.271.313,80	1,25%	5,00%	10,00%	30,00%	29.229.087,18
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.008.714,09	0,99%	0,00%	5,00%	15,00%	14.241.486,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	4.003.977,66	3,94%	0,00%	2,50%	5,00%	1.079.422,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	952.370,30	0,94%	0,00%	2,50%	5,00%	4.131.029,86
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.083.400,16
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.862.904,99	3,80%	0,00%	5,00%	5,00%	1.220.495,17
Desenquadrado - RF	0,00%	7.220.323,73	7,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.220.323,73
DF - Artigo 6º	100,00%	6.170.549,17	6,07%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.170.549,17
<b>Total Carteira</b>		<b>107.838.552,44</b>					

RENDA FIXA	103.975.647,45	96,42%
RENDA VARIÁVEL	3.862.904,99	3,58%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	77.126.007,43	71,52%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	6.222.391,27	5,77%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.271.313,80	1,18%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.008.714,09	0,94%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.003.977,66	3,71%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	952.370,30	0,88%	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	3.862.904,99	3,58%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	7.220.323,73	6,70%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	6.170.549,17	5,72%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>107.838.552,44</b>	<b>100,00%</b>	<b>67,00</b>	<b>270,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	0,85%	-	3,20%	-	-	-	1,20%	1,152%	-
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,76%	6,78%	2,98%	4,67%	-	-	0,90%	0,974%	-
IRF-M 1+	1,11%	13,22%	5,47%	7,73%	19,92%	45,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	13,00%	5,39%	7,45%	19,66%	45,75%	0,20%	1,312%	6,45%
135% do CDI	1,08%	10,04%	3,29%	7,19%	16,60%	39,37%	-	-	-
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	1,08%	10,06%	3,30%	7,21%	16,62%	16,34%	0,40%	-	-
125% do CDI	1,00%	9,26%	3,04%	6,64%	15,28%	35,99%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	1,00%	9,28%	3,05%	6,66%	15,30%	36,06%	0,30%	-	-
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,88%	1,82%	4,17%	8,92%	25,78%	0,20%	0,182%	0,30%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,58%	7,20%	2,52%	5,22%	10,51%	31,46%	0,20%	0,277%	1,60%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	74.223.002,20	68,83%
RJI CORRETORA DE VALORES	13.442.715,00	12,47%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	6.170.549,17	5,72%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.126.689,33	4,75%
SINGULARE INVEST	5.012.691,75	4,65%
Planner Corretora	3.862.904,99	3,58%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	76.589.784,48	71,02%
IMA-B	13.442.715,00	12,47%
DISP. FINANCEIRA	6.170.549,17	5,72%
FIDC	5.012.691,75	4,65%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.862.904,99	3,58%
IMA-B 5	1.271.313,80	1,18%
CRÉDITO PRIVADO	952.370,30	0,88%
IRF-M 1+	536.222,95	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%
Agosto	99.181.080,04	20.603.733,66	24.213.320,05	96.396.305,99	824.812,34	0,83%	0,72%	114,83%	0,23%
Acumulado no ano					6.785.957,79	7,62%	5,65%	135,06%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	530.664,21	0,00	0,00	536.222,95	5.558,74	1,05%	1,31%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.295.652,01	0,00	36.440,65	1.271.313,80	12.102,44	0,93%	0,18%	0,95%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.008.714,09	8.714,09	0,87%	-	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	6.169.910,57	0,00	0,00	6.222.391,27	52.480,70	0,85%	1,15%	0,85%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	52.144.755,67	20.031.189,00	31.926,55	72.734.408,95	590.390,83	0,82%	0,08%	0,89%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	7.165.775,01	0,00	0,00	7.220.323,73	54.548,72	0,76%	0,97%	0,76%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	946.876,70	0,00	0,00	952.370,30	5.493,60	0,58%	0,28%	0,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.438.850,05	0,00	17.649.126,73	3.855.375,53	65.652,21	0,31%	0,08%	0,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.886.013,02	0,00	2.889.056,71	0,00	3.043,69	0,11%	0,00%	0,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	7.895.329,16	0,00	7.902.710,91	0,00	7.381,75	0,09%	0,00%	0,79%
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	0,00	4.003.977,66	0,00	4.003.977,66	0,00	0,00%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>805.366,77</b>	<b>0,80%</b>	<b>0,23%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.800.719,26	0,00	0,00	3.862.904,99	62.185,73	1,64%	-	1,60%
Total Renda Variável					62.185,73	1,64%	0,00%	