

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
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.569.329,17	4,19%	1.221	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	73.254.201,51	67,12%	1.382	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	545.229,02	0,50%	196	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	D+67 a D+1464	Não há	6.294.730,84	5,77%	5	14,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.277.577,80	1,17%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	1.016.807,54	0,93%	15	1,83%	Artigo 7º, Inciso VI
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	Não se aplica	Não se aplica	4.082.439,36	3,74%	5	30,28%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	957.210,10	0,88%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.892.008,02	3,57%		17,24%	Artigo 8º, Inciso VI
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	7.298.378,38	6,69%	7	19,64%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			103.187.911,74				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.951.393,58				Artigo 6º
Total			109.139.305,32				

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%	78.368.759,70	75,95%	50,00%	70,00%	100,00%	24.819.152,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	6.294.730,84	6,10%	0,00%	0,00%	60,00%	55.618.016,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	1.277.577,80	1,24%	5,00%	10,00%	30,00%	29.678.795,72
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.016.807,54	0,99%	0,00%	5,00%	15,00%	14.461.379,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	4.082.439,36	3,96%	0,00%	2,50%	5,00%	1.076.956,23
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	957.210,10	0,93%	0,00%	2,50%	5,00%	4.202.185,49
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.159.395,59
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.892.008,02	3,77%	0,00%	5,00%	5,00%	1.267.387,57
Desenquadrado - RF	0,00%	7.298.378,38	7,07%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.298.378,38
DF - Artigo 6º	100,00%	5.951.393,58	5,77%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.951.393,58
Total Carteira		109.139.305,32					

RENDA FIXA	105.247.297,30	96,43%
RENDA VARIÁVEL	3.892.008,02	3,57%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	78.368.759,70	71,81%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	6.294.730,84	5,77%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.277.577,80	1,17%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.016.807,54	0,93%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.082.439,36	3,74%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	957.210,10	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	3.892.008,02	3,57%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	7.298.378,38	6,69%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	5.951.393,58	5,45%	0,00%	0,00%
Total	109.139.305,32	100,00%	67,00	270,00

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	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	1,16%	-	4,02%	3,81%	-	-	1,20%	0,704%	-
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	1,08%	7,93%	3,73%	4,69%	-	-	0,90%	0,597%	-
IRF-M 1+	1,73%	15,17%	5,69%	7,83%	19,22%	51,80%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,68%	14,89%	5,59%	7,62%	18,92%	51,25%	0,20%	1,331%	6,40%
135% do CDI	0,86%	10,98%	3,05%	6,60%	15,87%	38,50%	-	-	-
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	0,87%	11,01%	3,06%	6,62%	15,90%	15,62%	0,40%	0,017%	0,11%
125% do CDI	0,80%	10,13%	2,82%	6,10%	14,61%	35,20%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	0,80%	10,16%	2,83%	6,12%	14,64%	35,28%	0,30%	0,015%	-
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%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,51%	7,75%	2,41%	4,47%	10,03%	32,90%	0,20%	0,234%	1,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	6,40%	1,84%	3,82%	8,58%	25,31%	0,20%	0,237%	0,33%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	-	-	-	-	-	-	1,80%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	74.756.640,63	68,50%
RJI CORRETORA DE VALORES	13.593.109,22	12,45%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.951.393,58	5,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.846.906,97	5,36%
SINGULARE INVEST	5.099.246,90	4,67%
Planner Corretora	3.892.008,02	3,57%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	77.823.530,68	71,31%
IMA-B	13.593.109,22	12,45%
DISP. FINANCEIRA	5.951.393,58	5,45%
FIDC	5.099.246,90	4,67%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.892.008,02	3,57%
IMA-B 5	1.277.577,80	1,17%
CRÉDITO PRIVADO	957.210,10	0,88%
IRF-M 1+	545.229,02	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%
Maiο	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%
Setembro	96.396.305,99	2.635.281,65	1.756.458,64	98.070.770,60	795.641,60	0,82%	0,62%	131,02%	0,16%
Acumulado no ano					7.581.599,39	8,50%	6,30%	134,89%	

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(%)
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	4.003.977,66	0,00	0,00	4.082.439,36	78.461,70	1,96%	0,02%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	536.222,95	0,00	0,00	545.229,02	9.006,07	1,68%	1,33%	1,68%
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	6.222.391,27	0,00	0,00	6.294.730,84	72.339,57	1,16%	0,70%	1,16%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	7.220.323,73	0,00	0,00	7.298.378,38	78.054,65	1,08%	0,60%	1,08%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	1.008.714,09	0,00	0,00	1.016.807,54	8.093,45	0,80%	0,02%	0,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.734.408,95	0,00	0,00	73.254.201,51	519.792,56	0,71%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	952.370,30	0,00	0,00	957.210,10	4.839,80	0,51%	0,23%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.271.313,80	0,00	0,00	1.277.577,80	6.264,00	0,49%	0,24%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.855.375,53	2.635.281,65	1.947.766,39	4.569.329,17	26.438,38	0,41%	0,07%	0,71%
Total Renda Fixa					803.290,18	0,82%	0,16%	

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(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.862.904,99	0,00	0,00	3.892.008,02	29.103,03	0,75%	-	0,75%
				Total Renda Variável	29.103,03	0,75%	0,00%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	51.606.623,02	20.031.189,00	31.926,55	73.254.201,51	1.648.316,04	2,60%	2,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.323.078,09	5.143.850,59	21.196.893,12	4.569.329,17	299.293,61	1,63%	2,67%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	7.035.729,79	0,00	0,00	7.298.378,38	262.648,59	3,73%	3,73%
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	6.051.530,02	0,00	0,00	6.294.730,84	243.200,82	4,02%	4,02%
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	0,00	4.003.977,66	0,00	4.082.439,36	78.461,70	1,96%	3,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.602.791,81	1.299.862,85	7.967.710,91	0,00	65.056,25	0,82%	2,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	516.359,27	0,00	0,00	545.229,02	28.869,75	5,59%	5,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.290.589,54	0,00	36.440,65	1.277.577,80	23.428,91	1,83%	1,84%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	934.677,80	0,00	0,00	957.210,10	22.532,30	2,41%	2,41%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.550.286,59	1.339.329,19	2.909.056,71	0,00	19.440,93	0,67%	1,99%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.807,54	16.807,54	1,68%	2,83%
Total Renda Fixa					2.708.056,44	2,75%	

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 (%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.801.912,19	0,00	0,00	3.892.008,02	90.095,83	2,37%	-
				Total Renda Variável	90.095,83	2,37%	