

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.288.586,45	1,16%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.815.309,80	7,06%	1.223	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	73.708.233,32	66,59%	1.377	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	544.104,96	0,49%	203	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	Não se aplica	Não se aplica	4.118.641,30	3,72%	1	30,28%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	1.025.023,66	0,93%	12	2,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	964.765,20	0,87%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.916.302,83	3,54%		17,24%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	7.304.489,42	6,60%	8	10,73%	Desenquadrado - RF
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	D+67 a D+1464	Não há	6.294.583,06	5,69%	6	8,55%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			106.980.040,00				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.711.305,12	Artigo 6º			
Total			110.691.345,12				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.288.586,45	1,20%	50,00%	70,00%	100,00%	105.691.453,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	82.067.648,08	76,71%	5,00%	10,00%	30,00%	-49.973.636,08
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	16.047.006,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	5.143.664,96	4,81%	0,00%	2,50%	5,00%	205.337,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	964.765,20	0,90%	0,00%	2,50%	5,00%	4.384.236,80
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.349.002,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	3.916.302,83	3,66%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.916.302,83
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.349.002,00
Desenquadrado - RF	0,00%	13.599.072,48	12,71%	0,00%	0,00%	0,00%	-13.599.072,48
DF - Artigo 6º	100,00%	3.711.305,12	3,47%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.711.305,12
Total Carteira		110.691.345,12					

RENDA FIXA	106.775.042,29	96,46%
RENDA VARIÁVEL	3.916.302,83	3,54%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.288.586,45	1,16%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	82.067.648,08	74,14%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5.143.664,96	4,65%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	964.765,20	0,87%	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 IV, Alínea ' b '	3.916.302,83	3,54%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	13.599.072,48	12,29%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	3.711.305,12	3,35%	0,00%	0,00%
Total	110.691.345,12	100,00%	67,00	270,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	75.217.103,48	67,95%	0,02%
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	13.599.072,48	12,29%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.103.896,25	8,22%	0,00%
TERCON ASSET MANAGEMENT	4.118.641,30	3,72%	1,21%
OURO PRETO INVESTIMENTOS	3.916.302,83	3,54%	0,19%
SINGULARE INVEST	1.025.023,66	0,93%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
135% do CDI	0,87%	11,95%	2,84%	6,40%	15,24%	37,64%	-	-	-
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	0,89%	12,00%	2,86%	6,43%	15,29%	14,92%	0,40%	0,031%	-
125% do CDI	0,80%	11,02%	2,63%	5,91%	14,04%	34,42%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	0,81%	11,05%	2,64%	5,93%	14,07%	34,50%	0,30%	0,009%	-
IRF-M 1	0,62%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	9,66%	2,24%	5,14%	12,09%	28,45%	0,20%	0,091%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	9,60%	2,21%	5,11%	12,01%	28,25%	0,10%	0,077%	0,68%
IPCA	0,42%	2,21%	0,77%	1,09%	2,70%	10,79%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	7,32%	2,32%	4,07%	8,87%	24,92%	0,20%	0,093%	0,32%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,79%	8,60%	1,89%	4,55%	10,71%	29,91%	0,20%	0,230%	1,49%
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,08%	8,02%	1,94%	4,29%	-	-	0,90%	0,656%	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	-0,00%	-	2,02%	4,48%	-	-	1,20%	0,809%	-
IRF-M 1+	-0,07%	15,09%	2,78%	7,31%	17,56%	50,69%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,21%	14,66%	2,53%	7,04%	16,99%	50,11%	0,20%	1,478%	6,39%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	75.217.103,48	67,95%
RJI CORRETORA DE VALORES	13.599.072,48	12,29%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.103.896,25	8,22%
SINGULARE INVEST	5.143.664,96	4,65%
Planner Corretora	3.916.302,83	3,54%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.711.305,12	3,35%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	81.523.543,12	73,65%
IMA-B	13.599.072,48	12,29%
FIDC	5.143.664,96	4,65%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.916.302,83	3,54%
DISP. FINANCEIRA	3.711.305,12	3,35%
IMA-B 5	1.288.586,45	1,16%
CRÉDITO PRIVADO	964.765,20	0,87%
IRF-M 1+	544.104,96	0,49%

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%
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%
Outubro	98.070.770,60	5.166.224,79	2.147.656,80	101.651.185,51	561.846,92	0,56%	0,91%	61,16%	0,18%
Acumulado no ano					8.143.446,31	9,11%	7,27%	125,26%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3 LP	4.082.439,36	0,00	0,00	4.118.641,30	36.201,94	0,89%	0,03%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.277.577,80	0,00	0,00	1.288.586,45	11.008,65	0,86%	0,09%	0,86%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	1.016.807,54	0,00	0,00	1.025.023,66	8.216,12	0,81%	0,01%	0,81%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	957.210,10	0,00	0,00	964.765,20	7.555,10	0,79%	0,23%	0,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.254.201,51	0,00	0,00	73.708.233,32	454.031,81	0,62%	0,09%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.569.329,17	5.466.224,79	2.268.146,97	7.815.309,80	47.902,81	0,48%	0,08%	0,61%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	7.298.378,38	0,00	0,00	7.304.489,42	6.111,04	0,08%	0,66%	0,08%
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	6.294.730,84	0,00	0,00	6.294.583,06	-147,78	0,00%	0,81%	-0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	545.229,02	0,00	0,00	544.104,96	-1.124,06	-0,21%	1,48%	-0,21%
Total Renda Fixa					569.755,63	0,56%	0,18%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.892.008,02	0,00	0,00	3.916.302,83	24.294,81	0,62%	-	0,62%
Total Renda Variável					24.294,81	0,62%	0,00%	