

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
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.287.815,73	3,39%	54	1,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.663.227,91	2,46%	74	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.429.184,40	9,51%	1.377	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.863.227,73	7,20%	764	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	819.385,55	1,21%	639	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	41.733.839,16	61,76%	1.223	0,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	63.432,82	0,09%	756	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.130.812,98	13,51%	3.078	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	583.811,43	0,86%	203	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
Total			67.574.737,71				

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%	0,00	0,00%	50,00%	70,00%	100,00%	67.574.737,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	40.544.842,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	40.544.842,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	67.574.737,71	100,00%	0,00%	0,00%	30,00%	-47.302.316,40
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	10.136.210,66
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	16.893.684,43
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.378.736,89
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.378.736,89
Total Carteira		67.574.737,71					

RENDA FIXA	67.574.737,71	100,00%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	67.574.737,71	100,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	25,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total	67.574.737,71	100,00%	0,00	475,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.616.657,53	63,07%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.539.451,47	20,04%	0,00%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	11.418.628,71	16,90%	0,13%

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
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,68%	8,83%	2,13%	4,75%	11,22%	26,72%	0,20%	0,029%	0,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,65%	8,76%	2,09%	4,71%	11,12%	26,74%	0,20%	0,022%	0,12%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,64%	8,58%	2,03%	4,58%	10,52%	25,51%	0,50%	0,044%	0,32%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,86%	1,83%	4,15%	10,07%	24,57%	1,00%	0,010%	0,12%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,41%	10,04%	2,32%	5,16%	-	-	0,20%	0,596%	-
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,38%	12,06%	2,50%	5,51%	13,86%	41,18%	0,20%	1,693%	8,13%
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%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.616.657,53	63,07%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.539.451,47	20,04%
Santander Securities Services	11.418.628,71	16,90%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	48.163.023,56	71,27%
CDI	14.876.859,08	22,02%
IMA-B	2.287.815,73	3,39%
GESTÃO DURATION	1.663.227,91	2,46%
IRF-M 1+	583.811,43	0,86%

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	57.633.174,85	0,00	233.782,97	58.115.238,99	715.847,11	1,24%	0,89%	139,26%	0,37%
Fevereiro	58.115.238,99	1.153.317,10	233.351,97	59.668.820,81	633.616,69	1,07%	0,75%	143,40%	0,17%
Março	59.668.820,81	678.308,31	255.954,32	60.750.280,14	659.105,34	1,10%	0,78%	139,80%	0,22%
Abril	60.750.280,14	1.572.259,26	1.000.911,12	61.799.880,49	478.252,21	0,78%	0,56%	139,85%	0,22%
Mai	61.799.880,49	738.526,00	250.964,88	62.784.947,32	497.505,71	0,80%	0,82%	97,22%	1,34%
Junho	62.784.947,32	735.988,95	289.886,74	63.751.531,55	520.482,02	0,82%	0,26%	322,00%	0,23%
Julho	63.751.531,55	1.365.690,15	1.058.666,75	64.773.286,34	714.731,39	1,12%	0,73%	153,28%	0,25%
Agosto	64.773.286,34	1.631.351,12	1.174.212,38	65.796.641,04	566.215,96	0,87%	0,72%	119,85%	0,13%
Setembro	65.796.641,04	1.637.815,82	1.105.073,37	66.814.451,70	485.068,21	0,73%	0,62%	117,15%	0,12%
Outubro	66.814.451,70	826.820,67	448.735,31	67.574.737,71	382.200,65	0,57%	0,91%	62,59%	0,15%
Acumulado no ano					5.653.025,29	9,48%	7,27%	130,35%	

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(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	63.006,65	0,00	0,00	63.432,82	426,17	0,68%	0,03%	0,68%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.831.623,07	0,00	0,00	4.863.227,73	31.604,66	0,65%	0,02%	0,65%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	9.072.455,63	0,00	0,00	9.130.812,98	58.357,35	0,64%	0,04%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.389.581,58	0,00	0,00	6.429.184,40	39.602,82	0,62%	0,09%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.911.283,16	0,00	432.413,55	41.733.839,16	254.969,55	0,61%	0,08%	0,61%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.656.380,30	0,00	0,00	1.663.227,91	6.847,61	0,41%	0,60%	0,41%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.464,73	826.820,67	16.321,76	819.385,55	421,91	0,05%	0,01%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	585.017,52	0,00	0,00	583.811,43	-1.206,09	-0,21%	1,48%	-0,21%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.296.639,06	0,00	0,00	2.287.815,73	-8.823,33	-0,38%	1,69%	-0,38%
Total Renda Fixa					382.200,65	0,57%	0,15%	