Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano 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 (dezembro / 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	D+0	Não há	8.208.271,88	10,10%	1.412	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.250.057,64	6,46%	722	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.201.422,08	16,25%	1.226	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.643.898,71	8,18%	143	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.716.349,29	11,96%	619	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.069.454,40	9,93%	297	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.323.645,75	15,17%	712	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.032.468,48	8,66%	703	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	6.251.021,46	7,69%	748	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	47.935,54	0,06%	235	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	200.717,84	0,25%	632	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.809.166,80	3,46%	103	1,71%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.498.000,00	1,84%		0,89%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
		Total	**81.252.409,87**				

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

Artigos	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	63.801.669,52	78,52%	50,00%	50,00%	80,00%	1.200.258,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	30,00%	24.375.722,96
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	12.187.861,48
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.062.620,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.062.620,49
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	8.125.240,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	8.125.240,99
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	2.809.166,80	3,46%	0,00%	5,00%	5,00%	1.253.453,69
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.062.620,49
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	1.498.000,00	1,84%	0,00%	5,00%	5,00%	2.564.620,49
Total Carteira		68.108.836,32					

RENDA FIXA	76.945.243,07	112,97%
RENDA VARIÁVEL	4.307.166,80	6,32%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	63.801.669,52	78,52%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	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 '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	2.809.166,80	3,46%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.498.000,00	1,84%	0,00%	5,00%
Total	68.108.836,32	83,82%	67,00	240,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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	46.073.558,69	56,70%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.178.851,18	43,30%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,245%	15,20%	1,44%	6,42%	15,20%	42,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	14,80%	1,27%	6,17%	14,80%	41,50%	0,20%	0,843%	4,59%
IDKA IPCA 2 Anos	1,162%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,34%	1,85%	6,25%	12,34%	29,13%	0,20%	0,454%	2,69%
IMA-B 5	0,884%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,38%	1,42%	6,63%	12,38%	29,45%	0,20%	0,671%	3,50%
IMA-B	0,828%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	12,55%	-0,39%	6,83%	12,55%	40,19%	0,20%	1,422%	9,24%
IRF-M 1	0,566%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	4,51%	10,93%	27,11%	0,20%	0,031%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	10,86%	1,77%	4,48%	10,86%	26,92%	0,10%	0,040%	0,68%
CDI	0,538%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,94%	1,74%	4,01%	9,94%	25,33%	0,20%	0,021%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	8,87%	1,49%	3,51%	8,87%	23,14%	1,00%	0,010%	0,12%
IPCA	0,440%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	9,30%	2,44%	4,44%	9,30%	23,99%	0,20%	0,109%	0,31%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	12,40%	1,91%	6,33%	12,40%	29,14%	0,20%	0,463%	2,75%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,47%	9,05%	1,56%	3,63%	9,05%	23,28%	0,80%	0,006%	0,12%

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

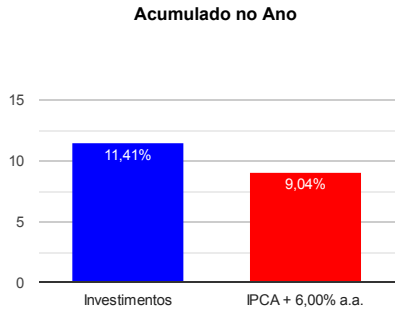
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,60%	19,41%	0,24%	7,34%	19,41%	58,02%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,00%	4,90%	-2,72%	0,00%	4,90%	33,75%	1,20%	8,878%	23,30%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	12,08%	2,24%	5,49%	12,08%	27,16%	0,60%	0,319%	4,02%

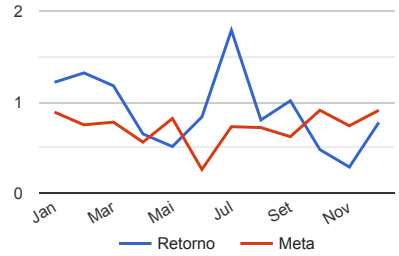
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2017)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	46.073.558,69	56,70%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.178.851,18	43,30%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	22.039.995,04	27,13%
IRF-M 1	21.409.693,96	26,35%
IMA-B 5	13.676.367,19	16,83%
IRF-M	8.069.454,40	9,93%
CDI	6.499.674,84	8,00%
IMA-B	5.250.057,64	6,46%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.809.166,80	3,46%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.498.000,00	1,84%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017





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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.396.891,06	0,00	1.435.000,00	8.069.454,40	107.563,34	1,14%	0,84%	1,19%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.632.506,60	0,00	0,00	9.716.349,29	83.842,69	0,87%	0,45%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.971.895,95	0,00	0,00	7.032.468,48	60.572,53	0,87%	0,67%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.218.192,25	0,00	0,00	12.323.645,75	105.453,50	0,86%	0,46%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.208.053,36	0,00	0,00	5.250.057,64	42.004,28	0,81%	1,42%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.596.983,34	0,00	0,00	6.643.898,71	46.915,37	0,71%	0,11%	0,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.161.926,02	0,00	0,00	8.208.271,88	46.345,86	0,57%	0,03%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.128.068,57	0,00	0,00	13.201.422,08	73.353,51	0,56%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.218.461,47	0,00	0,00	6.251.021,46	32.559,99	0,52%	0,02%	0,52%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	172.659,67	27.238,64	0,00	200.717,84	819,53	0,41%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	957.357,78	309.239,38	1.219.600,37	47.935,54	938,75	0,07%	0,01%	0,47%
			Total Renda Fixa		600.369,35	0,76%	0,40%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.477.000,00	0,00	0,00	1.498.000,00	21.000,00	1,42%	8,88%	1,42%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.786.521,63	0,00	0,00	2.809.166,80	22.645,17	0,81%	0,32%	0,81%
			Total Renda Variável		43.645,17	1,02%	3,30%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.092.174,21	0,00	0,00	12.323.645,75	231.471,54	1,91%	1,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.972.133,43	0,00	0,00	13.201.422,08	229.288,65	1,77%	1,77%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.459.905,48	80.000,00	0,00	9.716.349,29	176.443,81	1,85%	1,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.485.470,43	0,00	0,00	6.643.898,71	158.428,28	2,44%	2,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.063.877,33	0,00	0,00	8.208.271,88	144.394,55	1,79%	1,79%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.389.012,01	0,00	1.435.000,00	8.069.454,40	115.442,39	1,23%	1,27%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.143.983,87	0,00	0,00	6.251.021,46	107.037,59	1,74%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.933.676,14	0,00	0,00	7.032.468,48	98.792,34	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	109.820,87	3.331.939,50	3.400.372,01	47.935,54	6.547,18	0,42%	1,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	116.814,29	81.612,30	0,00	200.717,84	2.291,25	1,35%	1,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.468.742,34	800.000,00	0,00	5.250.057,64	-18.684,70	-0,35%	-0,39%
			Total Renda Fixa		1.251.452,88	1,61%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.747.495,88	0,00	0,00	2.809.166,80	61.670,92	2,24%	2,24%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.539.958,00	0,00	0,00	1.498.000,00	-41.958,00	-2,72%	-2,72%
			Total Renda Variável		19.712,92	0,46%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.557.878,57	415.407,86	0,00	12.323.645,75	1.350.359,32	12,35%	12,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.852.586,78	0,00	1.000.000,00	13.201.422,08	1.348.835,30	10,84%	10,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.615.014,98	2.906.800,00	1.435.000,00	8.069.454,40	982.639,42	14,30%	14,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.418.239,48	5.370.565,49	12.000,00	9.716.349,29	939.544,32	11,80%	12,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.257.668,79	0,00	0,00	7.032.468,48	774.799,69	12,38%	12,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.123.658,30	2.460.000,00	50.000,00	8.208.271,88	674.613,58	10,75%	10,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.437.242,09	0,00	371.312,64	6.643.898,71	577.969,26	9,28%	9,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.685.851,69	0,00	0,00	6.251.021,46	565.169,77	9,94%	9,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.088.779,29	5.338.400,00	3.528.653,92	5.250.057,64	351.532,27	11,77%	12,55%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	9.437.567,56	9.401.392,25	47.935,54	11.760,23	0,64%	9,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	352.307,42	154.729,90	200.717,84	3.140,32	1,95%	8,87%
			Total Renda Fixa		7.580.363,48	11,53%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.506.327,69	0,00	0,00	2.809.166,80	302.839,11	12,08%	12,08%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.428.000,00	0,00	0,00	1.498.000,00	70.000,00	4,90%	4,90%
			Total Renda Variável		372.839,11	9,48%	