Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018

crédito & mercado
Consultoria em Investimentos

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

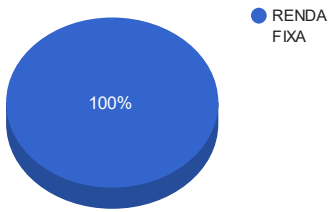
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.540.610,85	3,20%			Artigo 20
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.626.847,15	3,38%	204	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.118.918,31	8,56%	745	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.077.919,67	8,48%	716	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.881.084,04	8,07%	28	2,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.895.519,66	6,02%	1.225	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.163.423,24	37,75%	1.417	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	222.694,88	0,46%	239	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.514.626,63	7,31%	3.156	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.476.884,61	5,15%	427	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.592.566,04	11,62%	748	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	**48.111.095,08**				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2018)

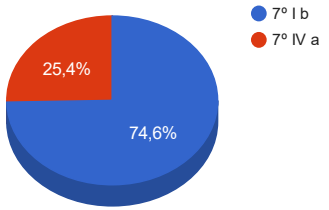
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	34.763.712,07	72,26%	0,00%	80,00%	100,00%	13.347.383,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	28.866.657,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.806.772,16	24,54%	0,00%	15,00%	40,00%	7.437.665,87
Total Renda Fixa	100,00%	46.570.484,23	96,80%	0,00	100,00	200,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00	35,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	34.763.712,07	72,26%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.806.772,16	24,54%	0,00%	40,00%
Total Renda Fixa	46.570.484,23	96,80%	0,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	0,00	0,00%	0,00	35,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 2018)

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)

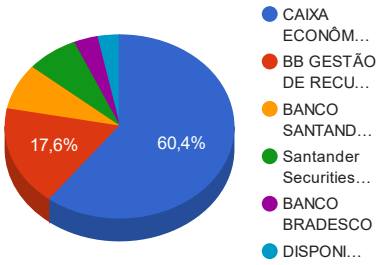
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.059.840,71	60,40%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.488.085,70	17,64%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	3.881.084,04	8,07%	0,00%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	3.514.626,63	7,31%	0,04%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.626.847,15	3,38%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

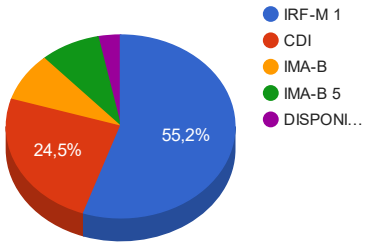
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,54%	1,14%	1,71%	3,74%	9,85%	25,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	1,68%	3,65%	9,68%	25,09%	0,20%	0,075%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	1,11%	1,68%	3,63%	9,62%	24,91%	0,10%	0,074%	0,65%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,52%	1,10%	1,66%	3,62%	9,64%	25,02%	0,20%	0,078%	0,65%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,51%	1,06%	1,62%	3,52%	9,46%	24,65%	0,40%	0,074%	0,65%
IMA-B 5	0,54%	1,88%	2,78%	4,42%	11,72%	26,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	1,85%	2,73%	4,32%	11,52%	26,20%	0,20%	0,783%	3,43%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,47%	1,04%	1,63%	3,56%	9,05%	24,14%	0,20%	0,010%	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	1,02%	1,57%	3,46%	8,84%	23,93%	0,20%	0,005%	0,16%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,43%	1,00%	1,51%	3,33%	8,67%	22,77%	0,50%	0,020%	0,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	0,92%	1,39%	3,08%	8,07%	22,06%	0,80%	0,003%	0,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (fevereiro / 2018)

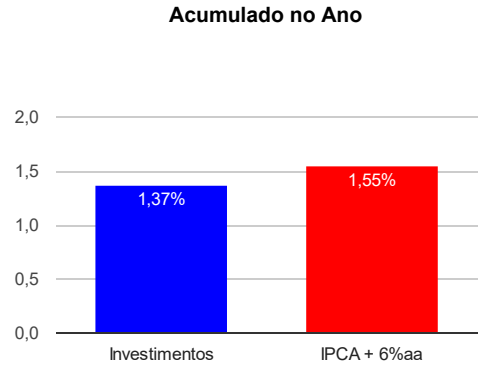
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.059.840,71	60,40%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.488.085,70	17,64%
BANCO SANTANDER	3.881.084,04	8,07%
Santander Securities Services	3.514.626,63	7,31%
BANCO BRADESCO	1.626.847,15	3,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.540.610,85	3,20%

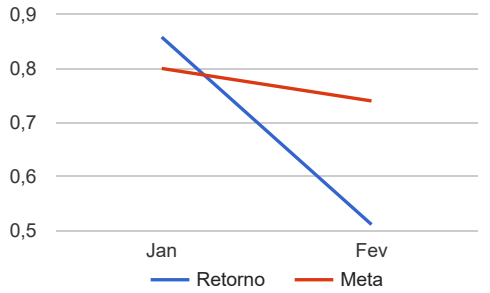


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	26.566.874,09	55,22%
CDI	11.806.772,16	24,54%
IMA-B	4.118.918,31	8,56%
IMA-B 5	4.077.919,67	8,48%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.540.610,85	3,20%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.034.967,57	61.550,00	0,00	4.118.918,31	22.400,74	0,55%	1,84%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.066.985,40	0,00	0,00	18.163.423,24	96.437,84	0,53%	0,07%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.996.305,62	60.000,00	0,00	4.077.919,67	21.614,05	0,53%	0,78%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.880.406,49	0,00	0,00	2.895.519,66	15.113,17	0,52%	0,07%	0,52%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.618.449,35	0,00	0,00	1.626.847,15	8.397,80	0,52%	0,08%	0,52%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.861.338,78	0,00	0,00	3.881.084,04	19.745,26	0,51%	0,07%	0,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.566.530,43	0,00	0,00	5.592.566,04	26.035,61	0,47%	0,01%	0,47%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.465.863,50	0,00	0,00	2.476.884,61	11.021,11	0,45%	0,01%	0,45%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	3.499.572,70	0,00	0,00	3.514.626,63	15.053,93	0,43%	0,02%	0,43%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	781.340,51	202.299,69	764.142,79	222.694,88	3.197,47	0,33%	0,00%	0,41%
			Total Renda Fixa		239.016,98	0,51%	0,28%	