

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018



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 (janeiro / 2018)

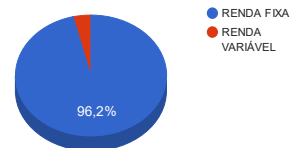
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	7.593.964,70	4,57%	223	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.749.982,45	10,69%	625	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	9.737.445,26	5,87%	167	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	66.790.574,78	40,23%	720	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	6.844.024,89	4,12%	52	2,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.292.117,08	4,99%	1.220	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	24.893.982,31	15,00%	33	7,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.456.698,00	1,48%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.681.509,74	3,42%	648	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	788.264,78	0,47%	756	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.035.867,62	1,83%	251	5,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	652.298,21	0,39%	1.403	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.051.822,67	0,63%	234	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	936.300,53	0,56%	123	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.103.615,00	1,27%	100	0,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.426.541,77	1,46%	88	1,14%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.115.793,61	0,67%	21.857	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.281.766,10	0,77%	4.939	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.539.043,50	0,93%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
Total para cálculo dos limites da Resolução			164.971.613,00				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.037.221,73				Artigo 6º
Total			166.008.834,73				

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

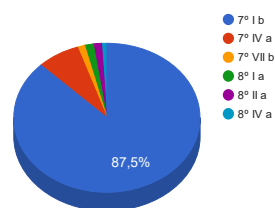
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	144.358.789,47	87,51%	50,00%	65,00%	100,00%	20.612.823,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	98.982.967,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	12.146.063,55	7,36%	0,00%	10,00%	30,00%	37.345.420,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.103.615,00	1,28%	0,00%	4,00%	5,00%	6.144.965,65
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.426.541,77	1,47%	0,00%	0,00%	20,00%	30.567.780,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.397.559,71	1,45%	0,00%	7,00%	15,00%	22.348.182,24
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	8.248.580,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.539.043,50	0,93%	0,00%	1,00%	5,00%	6.709.537,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	8.248.580,65
Total Carteira		164.971.613,00					

RENDA FIXA	159.645.689,75	96,77%
RENDA VARIÁVEL	6.363.144,98	3,86%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	144.358.789,47	86,96%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	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%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.146.063,55	7,32%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	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 "	2.103.615,00	1,27%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.426.541,77	1,46%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.397.559,71	1,44%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.539.043,50	0,93%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total	164.971.613,00	99,38%	50,00	440,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	127.506.554,75	76,81%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.956.082,82	18,65%	0,01%
ICATU VANGUARDA	3.035.867,62	1,83%	0,01%
FL Asset Management	1.539.043,50	0,93%	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.281.766,10	0,77%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	652.298,21	0,39%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,40%	3,40%	3,46%	6,35%	14,49%	42,84%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	1,17%	1,98%	4,59%	12,19%	27,57%	0,20%	0,448%	3,14%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	1,05%	1,61%	1,04%	4,30%	10,82%	0,20%	0,350%	4,31%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	2,02%	2,11%	7,18%	16,70%	0,20%	0,569%	5,52%
IPCA + 6,00% ao ano	0,80%	0,80%	2,47%	4,80%	8,95%	21,70%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	2,18%	2,68%	5,72%	14,43%	38,93%	0,15%	1,325%	6,31%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,99%	0,99%	1,75%	3,68%	9,48%	24,35%	0,20%	0,233%	1,28%
IDKA IPCA 2 Anos	0,77%	0,77%	2,20%	4,96%	13,25%	27,12%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	0,96%	2,12%	4,80%	12,27%	26,56%	0,20%	0,451%	2,69%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	2,06%	4,74%	12,22%	26,72%	0,20%	0,448%	2,62%
IRF-M 1	0,59%	0,59%	1,79%	4,11%	10,35%	26,16%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,59%	1,74%	4,00%	10,12%	25,62%	0,10%	0,109%	0,65%
CDI	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,58%	0,58%	1,69%	3,88%	9,54%	24,97%	0,20%	0,007%	0,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,57%	0,57%	1,73%	3,90%	9,51%	24,76%	0,20%	0,021%	0,13%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,70%	3,89%	9,61%	24,36%	0,20%	0,021%	0,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,51%	0,51%	1,49%	3,41%	8,50%	22,70%	0,80%	0,000%	0,11%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '1767' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rv.asp, line 58