Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2017

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 (dezembro / 2017)

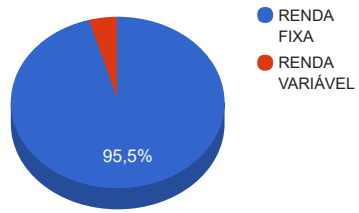
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.222.600,66	4,61%	1.226	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.233.869,16	12,20%	712	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.604.396,55	9,82%	588	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.643.316,84	9,97%	722	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.808.341,37	18,13%	1.412	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.944.346,18	14,88%	354	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.544.332,48	9,60%	377	1,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.330.753,10	16,33%	757	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	302.263,08	1,14%	103	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	880.491,37	3,32%	3.608	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	**26.514.710,79**				

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	14.512.524,58	54,73%	30,00%	40,00%	70,00%	4.047.772,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	30,00%	60,00%	15.908.826,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	10.819.431,76	40,81%	5,00%	10,00%	30,00%	-2.865.018,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.325.735,54
Total Renda Fixa	100,00%	25.331.956,34	95,54%	50,00	85,00	165,00	-

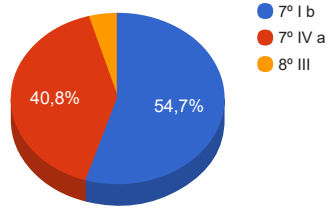
Distribuição por Segmento



⚠ O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.182.754,45	4,46%	0,00%	10,00%	15,00%	2.794.452,17
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.325.735,54
Total Renda Variável	30,00%	1.182.754,45	4,46%	0,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	14.512.524,58	54,73%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	10.819.431,76	40,81%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	25.331.956,34	95,54%	50,00	165,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	1.182.754,45	4,46%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	1.182.754,45	4,46%	0,00	20,00

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.638.228,73	58,98%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.876.482,06	41,02%	0,00%

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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
IDKA IPCA 2 Anos	1,16%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	9,05%	2,58%	4,73%	9,05%	22,83%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,65%	12,03%	1,66%	5,70%	12,03%	30,42%	0,30%	0,263%	2,25%
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,87%	12,42%	1,42%	6,65%	12,42%	29,60%	0,20%	0,674%	3,51%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	12,52%	-0,38%	6,80%	12,52%	40,11%	0,20%	1,420%	9,25%
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	0,57%	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	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	10,08%	1,83%	4,14%	10,08%	25,36%	0,20%	0,068%	0,13%

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

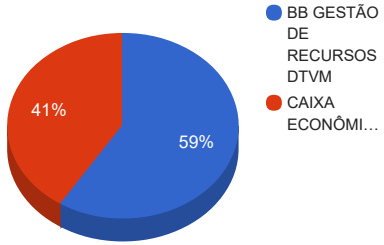
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
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%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,49%	10,00%	1,69%	4,34%	10,00%	28,47%	0,70%	0,073%	0,65%

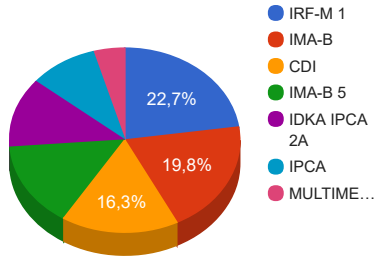
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.638.228,73	58,98%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.876.482,06	41,02%



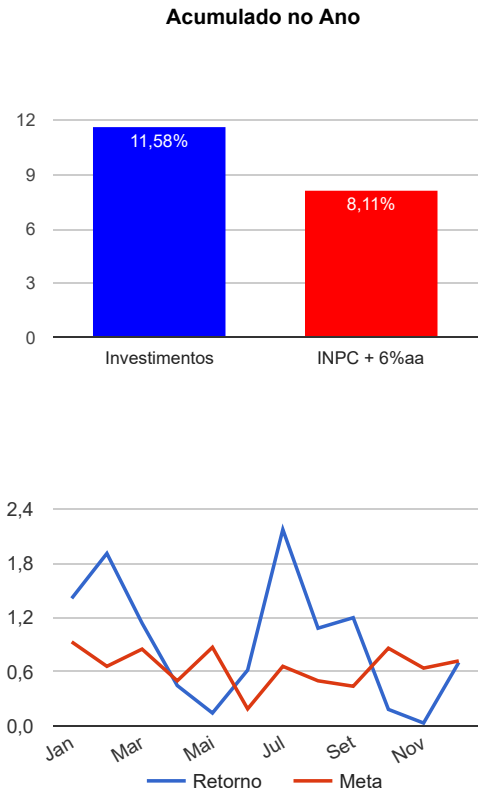
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	6.030.942,03	22,75%
IMA-B	5.247.713,39	19,79%
CDI	4.330.753,10	16,33%
IMA-B 5	3.944.346,18	14,88%
IDKA IPCA 2A	3.233.869,16	12,20%
IPCA	2.544.332,48	9,60%
MULTIMERCADO	1.182.754,45	4,46%



Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno ($)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	21.986.901,12	0,00	102.904,10	22.194.151,45	310.154,43	1,41%	0,93%	151,33%	1,30%
Fevereiro	22.194.151,45	440.574,52	103.986,08	22.960.343,14	429.603,25	1,91%	0,66%	289,75%	0,73%
Março	22.960.343,14	151.334,76	19.393,58	23.354.648,78	262.364,46	1,14%	0,85%	132,89%	0,83%
Abril	23.354.648,78	270.800,00	108.489,19	23.622.166,18	105.206,59	0,45%	0,50%	89,94%	0,75%
Maio	23.622.166,18	265.704,62	104.636,30	23.817.499,38	34.264,88	0,14%	0,87%	16,53%	5,18%
Junho	23.817.499,38	429.913,75	328.827,89	24.066.474,77	147.889,53	0,62%	0,19%	333,69%	0,97%
Julho	24.066.474,77	4.248.943,83	4.089.594,29	24.751.704,14	525.879,83	2,17%	0,66%	330,11%	1,20%
Agosto	24.751.704,14	274.559,69	113.858,85	25.181.729,59	269.324,61	1,08%	0,50%	214,90%	0,91%
Setembro	25.181.729,59	283.612,27	126.264,97	25.642.363,49	303.286,60	1,20%	0,44%	269,92%	0,70%
Outubro	25.642.363,49	332.455,83	128.627,98	25.893.831,49	47.640,15	0,18%	0,86%	21,47%	0,92%
Novembro	25.893.831,49	4.736.602,72	4.558.797,01	26.080.413,44	8.776,24	0,03%	0,64%	5,26%	0,70%
Dezembro	26.080.413,44	338.841,23	203.523,20	26.399.967,61	184.236,14	0,70%	0,72%	96,97%	0,49%
Acumulado no ano					2.628.626,71	11,58%	8,11%	142,76%	



Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.910.375,16	11.088,80	11.088,80	3.944.346,18	33.971,02	0,87%	0,67%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.929.178,39	278.402,08	0,00	3.233.869,16	26.288,69	0,82%	0,46%	0,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.583.506,42	0,00	0,00	2.604.396,55	20.890,13	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.622.168,38	0,00	0,00	2.643.316,84	21.148,46	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.515.216,42	12.809,90	0,00	2.544.332,48	16.306,16	0,65%	0,26%	0,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.269.197,07	36.540,45	0,00	4.330.753,10	25.015,58	0,58%	0,07%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.781.192,33	0,00	0,00	4.808.341,37	27.149,04	0,57%	0,03%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.432.215,98	2.031,69	219.129,69	1.222.600,66	7.482,68	0,52%	0,04%	0,56%
			Total Renda Fixa		178.251,76	0,71%	0,50%	

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	299.826,48	0,00	0,00	302.263,08	2.436,60	0,81%	0,32%	0,81%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	876.222,02	0,00	0,00	880.491,37	4.269,35	0,49%	0,07%	0,49%
			Total Renda Variável		6.705,95	0,57%	0,14%	

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.723.756,17	0,00	0,00	4.808.341,37	84.585,20	1,79%	1,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.062.405,48	192.803,18	0,00	4.330.753,10	75.544,44	1,81%	1,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.898.966,94	278.402,08	0,00	3.233.869,16	56.500,14	1,87%	1,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.904.976,14	2.011.088,80	11.088,80	3.944.346,18	39.370,04	1,24%	1,42%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1.286.312,65	1.227.467,79	0,00	2.544.332,48	30.552,04	1,54%	1,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	563.298,83	1.040.803,51	396.883,51	1.222.600,66	15.381,83	1,42%	1,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.653.747,77	0,00	0,00	2.643.316,84	-10.430,93	-0,39%	-0,39%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.039.201,55	0,00	1.028.277,00	0,00	-10.924,55	-1,05%	-1,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.929.777,60	0,00	2.300.000,00	2.604.396,55	-25.381,05	-0,14%	-0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.250.359,69	0,00	1.223.624,34	0,00	-26.735,35	-2,14%	-1,70%
			Total Renda Fixa		228.461,81	0,91%	

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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 (%)
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	507.991,98	359.896,11	0,00	880.491,37	12.603,28	1,47%	1,69%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	300.000,00	0,00	302.263,08	2.263,08	0,75%	2,24%
			Total Renda Variável		14.866,36	1,40%	

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.700.410,21	805.802,91	2.412.546,91	2.604.396,55	510.730,34	12,62%	12,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.800.978,34	0,00	500.000,00	4.808.341,37	507.363,03	10,93%	10,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.124.889,29	895.876,16	32.163,48	4.330.753,10	342.151,13	9,93%	10,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.628.538,12	278.402,08	0,00	3.233.869,16	326.928,96	12,35%	12,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.348.575,88	0,00	0,00	2.643.316,84	294.740,96	12,55%	12,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.238.753,39	2.536.078,02	11.088,80	3.944.346,18	180.603,57	11,64%	12,42%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.913.585,29	1.710.700,31	2.568.108,33	1.222.600,66	166.423,39	10,18%	10,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.087.978,88	0,00	1.202.124,07	0,00	114.145,19	10,49%	14,80%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.185.415,83	0,00	1.262.068,72	0,00	76.652,89	6,47%	9,94%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,00	2.489.536,51	0,00	2.544.332,48	54.795,97	3,49%	12,03%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	1.028.277,00	0,00	28.277,00	2,83%	12,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.202.087,57	1.223.624,34	0,00	21.536,77	1,79%	12,44%
			Total Renda Fixa		2.624.349,20	11,59%	

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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 (%)
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	859.896,11	0,00	880.491,37	20.595,26	3,09%	10,00%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	300.000,00	0,00	302.263,08	2.263,08	0,75%	12,08%
			Total Renda Variável		22.858,34		

Microsoft VBScript runtime error '800a000d'

Type mismatch: 'FormatNumber'

/plataforma/relatorios/uRetornoAnoRV.asp
line 143