Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2017)

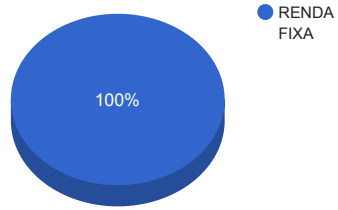
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	771.273,98	9,96%	1.197	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.158.266,77	27,88%	739	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.668.718,73	21,56%	703	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	339.860,59	4,39%	111	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.321.290,48	17,07%	605	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	535.707,76	6,92%	766	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	368.174,85	4,76%	6.372	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	552.113,12	7,13%	772	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	25.917,31	0,33%	750	0,23%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
		TOTAL -	**7.741.323,59**				

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 (julho / 2017)

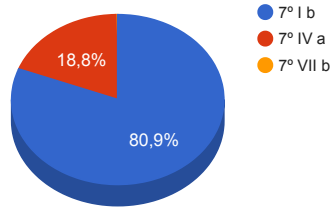
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	6.259.410,55	80,86%	30,00%	40,00%	80,00%	-66.351,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	30,00%	60,00%	4.644.794,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	1.455.995,73	18,81%	5,00%	10,00%	30,00%	866.401,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	25.917,31	0,33%	0,00%	5,00%	5,00%	361.148,87
Total Renda Fixa	100,00%	7.741.323,59	100,00%	50,00	85,00	175,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	1.161.198,54
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	387.066,18
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	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: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	6.259.410,55	80,86%	30,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.455.995,73	18,81%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	25.917,31	0,33%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	7.741.323,59	100,00%	50,00	175,00

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

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

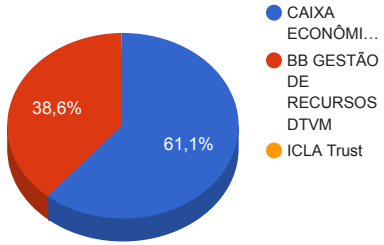
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	4,00%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,97%	9,54%	2,89%	7,56%	14,82%	36,75%	0,20%	2,253%	9,84%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,96%	9,52%	2,86%	7,54%	14,73%	37,86%	0,20%	2,242%	9,85%
IMA-B 5	2,85%	8,47%	3,47%	7,23%	13,72%	32,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,82%	8,37%	3,44%	7,15%	13,53%	31,44%	0,20%	1,220%	3,64%
IMA Geral ex-C	2,32%	9,14%	3,27%	7,24%	15,38%	34,79%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,31%	9,01%	3,20%	7,10%	15,16%	34,22%	0,20%	1,024%	4,95%
IRF-M 1	1,05%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,23%	2,83%	5,89%	13,20%	29,51%	0,10%	0,212%	0,67%
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	6,56%	2,56%	5,40%	12,68%	28,28%	0,20%	0,007%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	6,53%	2,56%	5,40%	12,54%	28,36%	0,20%	0,017%	0,10%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,78%	6,51%	2,56%	5,38%	12,55%	28,44%	0,25%	0,013%	0,10%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,95%	-26,33%	-17,14%	-25,27%	30,57%	70,94%	2,00%	0,405%	68,37%

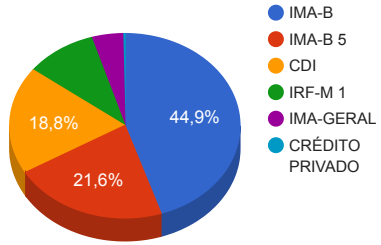
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.730.868,11	61,11%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.984.538,17	38,55%
ICLA Trust	25.917,31	0,33%



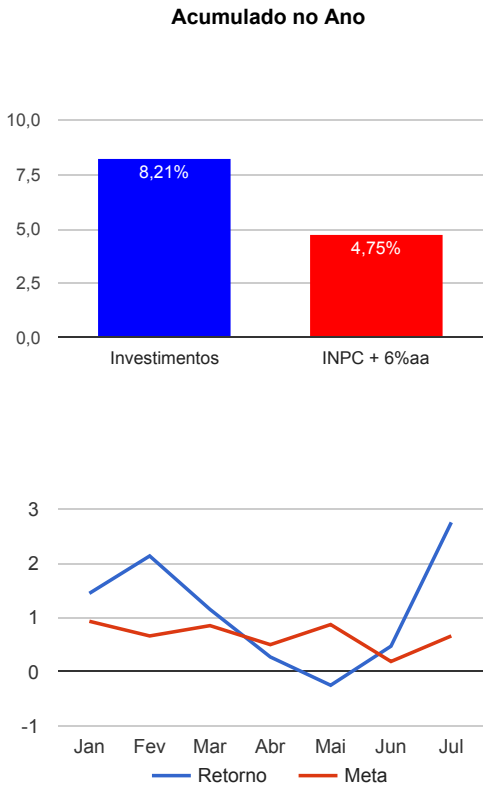
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	3.479.557,25	44,95%
IMA-B 5	1.668.718,73	21,56%
CDI	1.455.995,73	18,81%
IRF-M 1	771.273,98	9,96%
IMA-GERAL	339.860,59	4,39%
CRÉDITO PRIVADO	25.917,31	0,33%



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	8.672.462,34	6.448,54	600.000,00	8.204.145,28	125.234,40	1,44%	0,93%	154,92%	1,61%
Fevereiro	8.204.145,28	10.958,53	220.000,00	8.170.035,27	174.931,46	2,13%	0,66%	324,01%	0,96%
Março	8.170.035,27	587.543,10	450.000,00	8.403.003,35	95.424,98	1,15%	0,85%	134,35%	1,09%
Abril	8.403.003,35	15.030,42	130.000,00	8.310.983,79	22.950,02	0,27%	0,50%	54,91%	0,99%
Maio	8.310.983,79	471.305,46	615.000,00	8.146.721,30	-20.567,95	-0,25%	0,87%	-28,39%	6,90%
Junho	8.146.721,30	9.035,74	606.328,16	7.587.850,10	38.421,22	0,47%	0,19%	254,52%	1,39%
Julho	7.587.850,10	564.807,89	620.000,00	7.741.323,59	208.665,60	2,75%	0,66%	418,20%	1,34%
Acumulado no ano					645.059,73	8,21%	4,75%	172,96%	



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 julho / 2017

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	2.075.797,87	0,00	0,00	2.158.266,77	82.468,90	3,97%	2,25%	3,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.271.000,95	0,00	0,00	1.321.290,48	50.289,53	3,96%	2,24%	3,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.076.180,41	550.000,00	0,00	1.668.718,73	42.538,32	2,62%	1,22%	2,82%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	332.184,52	0,00	0,00	339.860,59	7.676,07	2,31%	1,02%	2,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.377.202,48	0,00	620.000,00	771.273,98	14.071,50	1,02%	0,21%	1,06%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	25.674,41	0,00	0,00	25.917,31	242,90	0,95%	0,40%	0,95%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	541.417,37	6.292,95	0,00	552.113,12	4.402,80	0,80%	0,01%	0,81%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	365.307,89	0,00	0,00	368.174,85	2.866,96	0,78%	0,01%	0,78%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	523.084,20	8.514,94	0,00	535.707,76	4.108,62	0,77%	0,02%	0,79%
			Total Renda Fixa		208.665,60	2,75%	1,34%	

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