

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 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	29.448.291,06	41,67%	1.341	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.729.137,95	2,45%	643	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.619.994,61	5,12%	722	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	26.599.843,73	37,64%	1.177	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	294.532,25	0,42%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	845.795,46	1,20%	776	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.126.264,70	11,50%	764	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV
Total para cálculo dos limites da Resolução			70.663.859,76				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.486,52				Artigo 6º
Total			70.667.346,28				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	2,50%	1.766.596,49
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	61.691.799,60	87,30%	20,00%	29,50%	70,00%	-12.227.097,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	42.398.315,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	21.199.157,93
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	10.599.578,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.533.192,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.533.192,99
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.119.915,79
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	8.479.663,17
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.533.192,99
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.533.192,99
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.533.192,99
DF - Artigo 6º	100,00%	3.486,52	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.486,52
Total Carteira		61.695.286,12					

RENDA FIXA	70.667.346,28	114,54%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	61.691.799,60	87,30%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	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%	3,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	12,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	3.486,52	0,00%	0,00%	0,00%
Total	61.695.286,12	87,30%	56,00	217,50

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	2,013%	4,34%	6,27%	10,02%	23,33%	35,09%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	4,35%	6,23%	9,96%	23,21%	34,54%	0,20%	0,949%	3,52%
IDKA IPCA 2 Anos	1,351%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	2,42%	3,70%	6,10%	12,74%	31,60%	0,20%	0,609%	2,20%
IRF-M 1	1,007%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%
CDI	0,864%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	2,00%	3,16%	6,52%	13,85%	29,49%	0,20%	0,015%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	1,96%	3,09%	6,43%	13,90%	29,43%	0,20%	0,044%	0,05%
IPCA	0,330%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,59%	2,74%	4,19%	6,44%	13,77%	-	0,20%	0,854%	2,56%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	37.574.555,76	53,17%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.089.304,00	46,82%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.486,52	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	56.048.134,79	79,31%
CDI	8.972.060,16	12,70%
IDKA IPCA 2A	3.619.994,61	5,12%
IRF-M	1.729.137,95	2,45%
IMA-B 5	294.532,25	0,42%
DISP. FINANCEIRA	3.486,52	0,00%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	69.676.835,14	243.291,75	574.958,38	70.218.443,07	873.274,56	1,25%	0,89%	140,52%	0,33%
Fevereiro	70.218.443,07	574.894,55	411.601,33	70.663.859,76	282.123,47	0,40%	0,75%	53,56%	0,13%
Acumulado no ano					1.155.398,03	1,66%	1,65%	100,74%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.686.088,69	9.129,37	0,00	1.729.137,95	33.919,89	2,00%	0,95%	2,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	298.345,82	0,00	8.521,33	294.532,25	4.707,76	1,58%	0,85%	1,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.416.538,73	156.364,50	0,00	3.619.994,61	47.091,38	1,32%	0,61%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	29.158.352,29	0,00	0,00	29.448.291,06	289.938,77	0,99%	0,08%	0,99%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	832.225,47	8.521,33	2.380,00	845.795,46	7.428,66	0,88%	0,02%	0,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.055.344,95	0,00	0,00	8.126.264,70	70.919,75	0,88%	0,04%	0,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.771.547,12	400.879,35	400.700,00	26.599.843,73	-171.882,74	-0,63%	0,08%	0,99%
Total Renda Fixa					282.123,47	0,40%	0,13%	

