

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.987.247,48	5,51%	719	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	29.776.422,16	41,15%	1.342	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.269.871,02	37,69%	1.170	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.763.869,23	2,44%	662	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	298.991,77	0,41%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.213.079,15	11,35%	754	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.043.133,62	1,44%	762	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>72.352.614,43</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			8.293,44				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>72.360.907,87</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (março / 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%	1.808.815,36
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	63.096.401,66	87,21%	20,00%	29,50%	70,00%	-12.449.571,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	43.411.568,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	21.705.784,33
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	10.852.892,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.617.630,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.617.630,72
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.170.578,43
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	8.682.313,73
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.617.630,72
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.617.630,72
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.617.630,72
DF - Artigo 6º	100,00%	8.293,44	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	-8.293,44
<b>Total Carteira</b>		<b>63.104.695,10</b>					

RENDA FIXA	72.360.907,87	114,67%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 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 '	63.096.401,66	87,20%	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	8.293,44	0,01%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>63.104.695,10</b>	<b>87,21%</b>	<b>56,00</b>	<b>217,50</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,621%	4,11%	4,11%	6,49%	14,06%	33,81%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	3,87%	3,87%	6,17%	13,72%	32,21%	0,20%	0,680%	1,94%
IRF-M	1,504%	5,91%	5,91%	9,53%	21,05%	37,17%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,47%	5,89%	5,89%	9,44%	20,94%	36,63%	0,20%	1,330%	3,26%
IRF-M 1	1,124%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	3,41%	3,41%	6,70%	13,92%	30,12%	0,20%	0,130%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,39%	3,39%	6,65%	13,82%	29,85%	0,10%	0,130%	0,30%
CDI	1,050%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	3,05%	3,05%	6,39%	13,77%	29,47%	0,20%	0,030%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	3,09%	3,09%	6,47%	13,79%	29,52%	0,20%	0,010%	0,17%
IPCA	0,250%	0,96%	0,96%	1,71%	4,57%	14,39%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,51%	4,29%	4,29%	6,57%	14,32%	32,43%	0,20%	0,870%	2,36%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	37.989.501,31	52,50%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.363.113,12	47,49%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	8.293,44	0,01%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	57.046.293,18	78,84%
CDI	9.256.212,77	12,79%
IDKA IPCA 2A	3.987.247,48	5,51%
IRF-M	1.763.869,23	2,44%
IMA-B 5	298.991,77	0,41%
DISP. FINANCEIRA	8.293,44	0,01%

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%
Março	70.663.859,76	898.581,15	429.781,52	72.352.614,43	1.219.955,04	1,72%	0,78%	218,60%	0,18%
Acumulado no ano					2.375.353,07	3,40%	2,44%	139,20%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.599.843,73	387.342,68	429.781,52	27.269.871,02	712.466,13	2,64%	0,13%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	294.532,25	0,00	0,00	298.991,77	4.459,52	1,51%	0,87%	1,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.729.137,95	9.129,37	0,00	1.763.869,23	25.601,91	1,47%	1,33%	1,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.619.994,61	315.078,37	0,00	3.987.247,48	52.174,50	1,33%	0,68%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	29.448.291,06	0,00	0,00	29.776.422,16	328.131,10	1,11%	0,13%	1,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.126.264,70	0,00	0,00	8.213.079,15	86.814,45	1,07%	0,03%	1,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	845.795,46	187.030,73	0,00	1.043.133,62	10.307,43	1,00%	0,01%	1,07%
Total Renda Fixa					1.219.955,04	1,72%	0,18%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º 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	28.795.892,82	0,00	0,00	29.776.422,16	980.529,34	3,41%	3,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.773.135,23	1.023.157,90	1.405.439,90	27.269.871,02	879.017,79	3,27%	3,39%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.969.721,72	0,00	0,00	8.213.079,15	243.357,43	3,05%	3,05%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.379.927,75	471.442,87	0,00	3.987.247,48	135.876,86	3,77%	3,87%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.639.948,13	26.614,62	0,00	1.763.869,23	97.306,48	5,88%	5,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	823.188,06	195.552,06	2.380,00	1.043.133,62	26.773,50	3,01%	3,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	295.021,43	0,00	8.521,33	298.991,77	12.491,67	4,28%	4,29%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.375.353,07</b>	<b>3,40%</b>	

