

Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 (abril / 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	4.176.564,17	5,72%	717	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	30.033.214,75	41,10%	1.339	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.455.316,53	37,57%	1.168	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.781.877,05	2,44%	668	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	300.966,26	0,41%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.278.207,42	11,33%	748	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.051.481,04	1,44%	754	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
Total para cálculo dos limites da Resolução			73.077.627,22				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.868,54	Artigo 6º			
Total			73.079.495,76				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 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%	1.826.940,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	63.747.938,76	87,23%	20,00%	29,50%	70,00%	-12.593.599,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	43.846.576,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	21.923.288,17
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	10.961.644,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.653.881,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.653.881,36
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.192.328,82
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	8.769.315,27
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.653.881,36
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.653.881,36
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.653.881,36
DF - Artigo 6º	100,00%	1.868,54	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.868,54
Total Carteira		63.749.807,30					

RENDA FIXA	73.079.495,76	114,63%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 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 '	63.747.938,76	87,23%	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	1.868,54	0,00%	0,00%	0,00%
Total	63.749.807,30	87,23%	56,00	217,50

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,924%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,66%	3,54%	6,53%	12,72%	32,84%	0,20%	0,481%	1,83%
IRF-M 1	0,874%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
CDI	0,785%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	3,87%	2,77%	6,12%	13,47%	29,25%	0,20%	0,018%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	3,89%	2,77%	6,17%	13,57%	29,27%	0,20%	0,015%	0,18%
IRF-M	0,535%	6,48%	4,10%	8,79%	17,62%	36,41%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	6,42%	4,03%	8,65%	17,43%	35,83%	0,20%	1,156%	3,09%
IPCA	0,140%	1,10%	0,72%	1,59%	4,08%	13,74%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	4,98%	3,81%	6,79%	13,34%	13,71%	0,20%	0,622%	2,29%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	38.311.422,17	52,42%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.766.205,05	47,57%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.868,54	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	57.488.531,28	78,67%
CDI	9.329.688,46	12,77%
IDKA IPCA 2A	4.176.564,17	5,72%
IRF-M	1.781.877,05	2,44%
IMA-B 5	300.966,26	0,41%
DISP. FINANCEIRA	1.868,54	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%
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%
Abril	72.352.614,43	556.944,44	437.798,06	73.077.627,22	605.866,41	0,84%	0,56%	149,91%	0,19%
Acumulado no ano					2.981.219,48	4,27%	3,02%	141,49%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	29.776.422,16	0,00	0,00	30.033.214,75	256.792,59	0,86%	0,16%	0,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.269.871,02	389.093,36	437.798,06	27.455.316,53	234.150,21	0,85%	0,16%	0,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.043.133,62	0,00	0,00	1.051.481,04	8.347,42	0,80%	0,01%	0,78%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.213.079,15	0,00	0,00	8.278.207,42	65.128,27	0,79%	0,02%	0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.987.247,48	158.721,71	0,00	4.176.564,17	30.594,98	0,74%	0,48%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	298.991,77	0,00	0,00	300.966,26	1.974,49	0,66%	0,62%	0,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.763.869,23	9.129,37	0,00	1.781.877,05	8.878,45	0,50%	1,16%	0,50%
Total Renda Fixa					605.866,41	0,84%	0,19%	

