

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 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	4.352.937,69	5,90%	716	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	30.303.934,80	41,05%	1.348	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.654.235,30	37,46%	1.184	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.795.432,30	2,43%	677	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	301.742,36	0,41%	167	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.355.355,16	11,32%	745	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.061.178,99	1,44%	761	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
Total para cálculo dos limites da Resolução			73.824.816,60				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			611,06				Artigo 6º
Total			73.825.427,66				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (maio / 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%	1.845.620,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	64.408.282,45	87,24%	20,00%	29,50%	70,00%	-12.730.910,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	44.294.889,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	22.147.444,98
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.073.722,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.691.240,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.691.240,83
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	2.214.744,50
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	12,00%	8.858.977,99
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.691.240,83
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.691.240,83
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.691.240,83
DF - Artigo 6º	100,00%	611,06	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-611,06
Total Carteira		64.408.893,51					

RENDA FIXA	73.825.427,66	114,62%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: maio / 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 '	64.408.282,45	87,24%	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	611,06	0,00%	0,00%	0,00%
Total	64.408.893,51	87,24%	56,00	217,50

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,352%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,25%	6,68%	2,24%	8,61%	17,38%	34,04%	0,20%	6,393%	4,86%
IRF-M 1	0,886%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,24%	2,91%	6,48%	13,48%	30,10%	0,20%	0,955%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	5,20%	2,87%	6,42%	13,36%	29,82%	0,10%	0,964%	0,66%
CDI	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,93%	4,84%	2,82%	6,00%	13,27%	29,19%	0,20%	0,030%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,92%	4,85%	2,80%	6,04%	13,32%	29,13%	0,20%	0,022%	0,18%
IDKA IPCA 2 Anos	0,793%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,07%	2,58%	6,38%	12,32%	30,95%	0,20%	3,873%	2,93%
IPCA	-0,230%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	5,25%	2,45%	6,74%	12,55%	29,97%	0,20%	4,542%	3,56%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	38.659.289,96	52,37%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.165.526,64	47,63%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	611,06	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	57.958.170,10	78,51%
CDI	9.416.534,15	12,76%
IDKA IPCA 2A	4.352.937,69	5,90%
IRF-M	1.795.432,30	2,43%
IMA-B 5	301.742,36	0,41%
DISP. FINANCEIRA	611,06	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%
Mai	73.077.627,22	587.071,66	463.200,00	73.824.816,60	623.317,72	0,85%	0,82%	103,64%	1,16%
Acumulado no ano					3.604.537,20	5,15%	3,86%	133,47%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.278.207,42	0,00	0,00	8.355.355,16	77.147,74	0,93%	0,03%	0,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.051.481,04	0,00	0,00	1.061.178,99	9.697,95	0,92%	0,02%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.033.214,75	0,00	0,00	30.303.934,80	270.720,05	0,90%	0,96%	0,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.455.316,53	418.426,97	463.200,00	27.654.235,30	243.691,80	0,87%	0,96%	0,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.176.564,17	159.515,32	0,00	4.352.937,69	16.858,20	0,39%	3,87%	0,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	300.966,26	0,00	0,00	301.742,36	776,10	0,26%	4,54%	0,26%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.781.877,05	9.129,37	0,00	1.795.432,30	4.425,88	0,25%	6,39%	0,25%
Total Renda Fixa					623.317,72	0,85%	1,16%	

