

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	8.444.112,49	75,76%	50,00%	75,00%	100,00%	2.701.157,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.343.581,02
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	293.543,21	2,63%	0,00%	5,00%	15,00%	1.378.247,30
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	369.716,55	3,32%	0,00%	5,00%	5,00%	187.546,95
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	205.998,00	1,85%	0,00%	5,00%	5,00%	351.265,50
DF - Artigo 6º	100,00%	4.849,25	0,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.849,25
Total Carteira		9.318.219,50					

RENTA FIXA	10.280.861,54	110,33%
RENTA VARIÁVEL	869.257,76	9,33%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.444.112,49	75,73%	50,00%	95,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	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%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	293.543,21	2,63%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	369.716,55	3,32%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	205.998,00	1,85%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	4.849,25	0,04%	0,00%	0,00%
Total	9.318.219,50	83,57%	62,00	265,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	2,284%	2,28%	4,50%	8,90%	22,76%	32,81%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	2,29%	4,44%	8,85%	22,68%	32,25%	0,20%	1,492%	3,59%

IMA-B	1,867%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	1,84%	3,47%	6,69%	24,54%	33,54%	0,20%	3,342%	7,49%

IRF-M 1	1,289%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%

CDI	1,085%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,10%	1,10%	3,32%	6,91%	13,93%	29,41%	0,20%	0,020%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,01%	1,01%	3,08%	6,40%	13,15%	27,30%	1,00%	0,011%	0,08%

Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,08%	2,89%	6,06%	12,74%	31,45%	0,20%	1,089%	2,32%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	8,58%	8,58%	5,25%	22,83%	92,63%	42,36%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6,68%	6,68%	-0,45%	1,56%	34,72%	6,53%	1,00%	7,604%	19,17%
IFIX	3,76%	3,76%	2,60%	11,47%	46,29%	40,96%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,98%	0,98%	-1,88%	6,30%	43,05%	25,61%	1,20%	12,385%	23,46%
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,12%	-0,12%	1,32%	4,90%	12,77%	27,29%	0,60%	3,083%	3,80%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.641.979,66	59,57%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.503.290,39	40,39%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.849,25	0,04%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.297.292,39	38,54%
IRF-M	2.240.827,86	20,10%
CDI	1.831.899,80	16,43%
IMA-B	1.552.013,07	13,92%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	369.716,55	3,32%
IDKA IPCA 2A	353.979,17	3,17%
FUNDO IMOBILIÁRIO	205.998,00	1,85%
DISP. FINANCEIRA	4.849,25	0,04%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	10.883.896,86	86.821,05	0,00	11.145.270,05	174.552,14	1,59%	0,89%	178,39%	1,44%
Acumulado no ano					174.552,14	1,59%	0,89%	178,39%	

Acumulado no Ano

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 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	2.190.567,15	0,00	0,00	2.240.827,86	50.260,71	2,29%	1,49%	2,29%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.523.907,71	0,00	0,00	1.552.013,07	28.105,36	1,84%	3,34%	1,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.243.873,91	0,00	0,00	4.297.292,39	53.418,48	1,26%	0,29%	1,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	811.254,72	0,00	0,00	820.161,12	8.906,40	1,10%	0,02%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	350.186,00	0,00	0,00	353.979,17	3.793,17	1,08%	1,09%	1,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	914.794,14	86.821,05	0,00	1.011.738,68	10.123,49	1,01%	0,01%	1,01%
Total Renda Fixa					154.607,61	1,53%	0,99%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	275.154,80	0,00	0,00	293.543,21	18.388,41	6,68%	7,60%	6,68%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	204.000,00	0,00	0,00	205.998,00	1.998,00	0,98%	12,38%	0,98%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	370.158,43	0,00	0,00	369.716,55	-441,88	-0,12%	3,08%	-0,12%
Total Renda Variável					19.944,53	2,35%	6,81%	