

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.

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 ' b '	100,00%	8.596.177,27	76,59%	50,00%	75,00%	100,00%	2.627.696,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.367.162,24
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	308.157,26	2,75%	0,00%	5,00%	15,00%	1.375.423,86
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	369.538,20	3,29%	0,00%	5,00%	5,00%	191.655,51
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	216.000,00	1,92%	0,00%	5,00%	5,00%	345.193,71
DF - Artigo 6º	100,00%	1.015,06	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.015,06
Total Carteira		9.490.887,79					

RENTA FIXA	10.331.193,73	108,85%
RENTA VARIÁVEL	893.695,46	9,42%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.596.177,27	76,58%	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	308.157,26	2,75%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	369.538,20	3,29%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	216.000,00	1,92%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	1.015,06	0,01%	0,00%	0,00%
Total	9.490.887,79	84,55%	62,00	265,00

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
IMA-B	3,849%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,85%	5,76%	8,82%	9,81%	26,50%	37,94%	0,20%	1,855%	7,39%
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%
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%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,80%	1,83%	2,90%	6,03%	13,03%	27,35%	1,00%	0,007%	0,08%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,00%	16,18%	15,16%	29,01%	90,61%	38,26%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,98%	11,99%	13,84%	8,14%	34,92%	4,71%	1,00%	6,430%	18,38%
IFIX	4,86%	8,80%	10,40%	14,77%	49,01%	48,14%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,86%	5,88%	10,77%	8,69%	45,95%	29,50%	1,20%	9,344%	23,42%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,05%	-0,17%	0,68%	3,58%	12,02%	26,57%	0,60%	3,280%	4,19%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.667.851,23	59,40%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.556.022,90	40,59%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.015,06	0,01%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.340.022,90	38,66%
IRF-M	2.285.770,33	20,36%
CDI	1.734.001,40	15,45%
IMA-B	1.611.710,98	14,36%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	369.538,20	3,29%
IDKA IPCA 2A	358.673,06	3,20%
FUNDO IMOBILIÁRIO	216.000,00	1,92%
DISP. FINANCEIRA	1.015,06	0,01%

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%
Fevereiro	11.145.270,05	258.329,00	371.714,16	11.223.874,13	191.989,24	1,72%	0,75%	230,16%	0,98%
Acumulado no ano					366.541,38	3,34%	1,65%	202,85%	

Acumulado no Ano

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.552.013,07	0,00	0,00	1.611.710,98	59.697,91	3,85%	1,85%	3,85%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.240.827,86	0,00	0,00	2.285.770,33	44.942,47	2,01%	0,95%	2,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	353.979,17	0,00	0,00	358.673,06	4.693,89	1,33%	0,61%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.297.292,39	0,00	0,00	4.340.022,90	42.730,51	0,99%	0,08%	0,99%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	820.161,12	0,00	0,00	827.473,68	7.312,56	0,89%	0,02%	0,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.011.738,68	258.329,00	371.714,16	906.527,72	8.174,20	0,64%	0,01%	0,80%
Total Renda Fixa					167.551,54	1,63%	0,56%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	293.543,21	0,00	0,00	308.157,26	14.614,05	4,98%	6,43%	4,98%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	205.998,00	0,00	0,00	216.000,00	10.002,00	4,86%	9,34%	4,86%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	369.716,55	0,00	0,00	369.538,20	-178,35	-0,05%	3,28%	-0,05%
Total Renda Variável					24.437,70	2,81%	5,83%	