

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.

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 ' b '	100,00%	8.918.772,21	78,13%	50,00%	75,00%	100,00%	2.496.819,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.424.677,37
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	304.612,94	2,67%	0,00%	5,00%	15,00%	1.407.725,74
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	379.758,85	3,33%	0,00%	5,00%	5,00%	191.020,71
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	210.000,00	1,84%	0,00%	5,00%	5,00%	360.779,56
Total Carteira		9.813.144,00					

RENTA FIXA	10.521.219,44	107,22%
RENTA VARIÁVEL	894.371,79	9,11%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.918.772,21	78,13%	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	304.612,94	2,67%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	379.758,85	3,33%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	210.000,00	1,84%	0,00%	5,00%
Total	9.813.144,00	85,96%	62,00	265,00

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
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%

CDI	1,050%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,97%	2,82%	2,82%	5,95%	12,94%	27,36%	1,00%	0,000%	0,09%

IMA-B	1,045%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,84%	6,84%	9,22%	21,32%	39,81%	0,20%	2,050%	6,16%

Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2,77%	2,59%	2,59%	4,94%	14,05%	28,67%	0,60%	2,970%	4,50%
IFIX	0,20%	9,01%	9,01%	11,89%	36,84%	50,85%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,78%	2,94%	2,94%	6,17%	28,05%	25,90%	1,20%	14,050%	23,53%
IDIV	-1,85%	14,03%	14,03%	26,96%	55,13%	41,56%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,15%	10,71%	10,71%	9,07%	21,67%	5,66%	1,00%	7,530%	17,18%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.598.160,25	57,80%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.817.430,98	42,20%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.607.430,98	40,36%
IRF-M	2.319.483,78	20,32%
IMA-B	1.628.133,62	14,26%
CDI	1.602.447,23	14,04%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	379.758,85	3,33%
IDKA IPCA 2A	363.723,83	3,19%
FUNDO IMOBILIÁRIO	210.000,00	1,84%

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	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%
Março	11.223.874,13	303.529,91	234.768,66	11.415.591,23	122.955,85	1,09%	0,78%	138,78%	1,20%
Acumulado no ano					489.497,23	4,47%	2,44%	182,70%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.285.770,33	0,00	0,00	2.319.483,78	33.713,45	1,47%	1,33%	1,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	358.673,06	0,00	0,00	363.723,83	5.050,77	1,41%	0,68%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.340.022,90	248.036,35	30.000,00	4.607.430,98	49.371,73	1,08%	0,13%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	827.473,68	0,00	0,00	836.299,40	8.825,72	1,07%	0,01%	1,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.611.710,98	0,00	0,00	1.628.133,62	16.422,64	1,02%	2,05%	1,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	906.527,72	55.493,56	204.768,66	766.147,83	8.895,21	0,92%	0,00%	0,97%
Total Renda Fixa					122.279,52	1,18%	0,69%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	369.538,20	0,00	0,00	379.758,85	10.220,65	2,77%	2,97%	2,77%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	308.157,26	0,00	0,00	304.612,94	-3.544,32	-1,15%	7,53%	-1,15%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	216.000,00	0,00	0,00	210.000,00	-6.000,00	-2,78%	14,05%	-2,78%
Total Renda Variável					676,33	0,08%	7,12%	

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	4.243.873,91	248.036,35	30.000,00	4.607.430,98	145.520,72	3,37%	3,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.190.567,15	0,00	0,00	2.319.483,78	128.916,63	5,89%	5,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.523.907,71	0,00	0,00	1.628.133,62	104.225,91	6,84%	6,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	914.794,14	400.643,61	576.482,82	766.147,83	27.192,90	2,60%	2,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	811.254,72	0,00	0,00	836.299,40	25.044,68	3,09%	3,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	350.186,00	0,00	0,00	363.723,83	13.537,83	3,87%	3,87%
Total Renda Fixa					444.438,67	4,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	275.154,80	0,00	0,00	304.612,94	29.458,14	10,71%	10,71%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	370.158,43	0,00	0,00	379.758,85	9.600,42	2,59%	2,59%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	204.000,00	0,00	0,00	210.000,00	6.000,00	2,94%	2,94%
Total Renda Variável					45.058,56	5,31%	