

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.

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 ' b '	100,00%	8.967.302,46	78,30%	50,00%	75,00%	100,00%	2.484.691,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.435.598,16
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	303.902,94	2,65%	0,00%	5,00%	15,00%	1.413.896,14
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	384.859,76	3,36%	0,00%	5,00%	5,00%	187.739,93
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	203.000,00	1,77%	0,00%	5,00%	5,00%	369.599,69
DF - Artigo 6º	100,00%	25.974,83	0,23%	0,00%	0,00%	0,00%	-25.974,83
Total Carteira		9.885.039,99					

RENTA FIXA	10.586.205,99	107,09%
RENTA VARIÁVEL	891.762,70	9,02%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.967.302,46	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	303.902,94	2,65%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	384.859,76	3,35%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	203.000,00	1,77%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	25.974,83	0,23%	0,00%	0,00%
Total	9.885.039,99	86,12%	62,00	265,00

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
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%
CDI	0,785%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
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%
IMA-B	-0,322%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,34%	6,47%	4,54%	8,17%	16,36%	35,97%	0,20%	1,900%	5,85%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	0,92%	15,08%	5,98%	11,54%	39,29%	27,73%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,23%	10,45%	3,53%	3,07%	16,65%	0,44%	1,00%	6,480%	16,45%
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,34%	3,97%	4,10%	5,47%	14,01%	29,15%	0,60%	2,107%	4,65%
IFIX	0,15%	9,17%	5,22%	7,96%	30,95%	45,67%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,33%	-0,49%	-1,46%	-3,30%	21,27%	35,33%	1,20%	8,214%	23,37%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.601.828,31	57,52%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.850.165,55	42,26%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	25.974,83	0,23%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.647.165,55	40,49%
IRF-M	2.331.113,67	20,31%
IMA-B	1.622.526,24	14,14%
CDI	1.592.928,70	13,88%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	384.859,76	3,35%
IDKA IPCA 2A	366.497,00	3,19%
FUNDO IMOBILIÁRIO	203.000,00	1,77%
DISP. FINANCEIRA	25.974,83	0,23%

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%
Abril	11.415.591,23	236.907,99	259.330,58	11.451.993,86	58.825,22	0,52%	0,56%	92,41%	0,97%
Acumulado no ano					548.322,45	5,00%	3,02%	165,94%	

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	4.607.430,98	0,00	0,00	4.647.165,55	39.734,57	0,86%	0,16%	0,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	836.299,40	0,00	0,00	842.845,50	6.546,10	0,78%	0,01%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	363.723,83	0,00	0,00	366.497,00	2.773,17	0,76%	0,48%	0,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	766.147,83	236.907,99	259.330,58	750.083,20	6.357,96	0,63%	0,01%	0,73%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.319.483,78	0,00	0,00	2.331.113,67	11.629,89	0,50%	1,16%	0,50%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.628.133,62	0,00	0,00	1.622.526,24	-5.607,38	-0,34%	1,90%	-0,34%
Total Renda Fixa					61.434,31	0,58%	0,64%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	379.758,85	0,00	0,00	384.859,76	5.100,91	1,34%	2,11%	1,34%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	304.612,94	0,00	0,00	303.902,94	-710,00	-0,23%	6,48%	-0,23%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	210.000,00	0,00	0,00	203.000,00	-7.000,00	-3,33%	8,21%	-3,33%
Total Renda Variável					-2.609,09	-0,29%	4,99%	