

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.

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 ' b '	100,00%	9.024.512,08	78,16%	50,00%	75,00%	100,00%	2.521.423,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	3.463.780,79
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	300.851,16	2,61%	0,00%	5,00%	15,00%	1.431.039,24
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	389.381,26	3,37%	0,00%	5,00%	5,00%	187.915,54
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	202.000,00	1,75%	0,00%	5,00%	5,00%	375.296,80
Total Carteira		9.916.744,50					

RENTA FIXA	10.653.703,56	107,43%
RENTA VARIÁVEL	892.232,42	9,00%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	9.024.512,08	78,16%	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	300.851,16	2,61%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	389.381,26	3,37%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	202.000,00	1,75%	0,00%	5,00%
Total	9.916.744,50	85,89%	62,00	265,00

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%
CDI	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	4,42%	2,54%	5,52%	12,44%	27,01%	1,00%	0,007%	0,10%
IMA-B	0,164%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,20%	5,20%	-0,53%	8,24%	15,11%	30,93%	0,20%	13,324%	9,79%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,49%	-0,98%	-6,48%	3,59%	10,10%	34,67%	1,20%	7,709%	21,55%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,17%	5,19%	5,37%	6,09%	14,23%	29,36%	0,60%	1,288%	4,70%
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,00%	9,34%	-2,37%	11,14%	20,40%	3,83%	1,00%	17,847%	19,05%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.627.375,14	57,40%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.918.560,84	42,60%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.716.560,84	40,85%
IRF-M	2.336.916,03	20,24%
CDI	1.629.191,48	14,11%
IMA-B	1.603.101,43	13,88%
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	389.381,26	3,37%
IDKA IPCA 2A	367.933,78	3,19%
FUNDO IMOBILIÁRIO	202.000,00	1,75%

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%
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%
Maiο	11.451.993,86	267.587,48	218.751,53	11.545.935,98	45.106,17	0,39%	0,82%	47,74%	4,30%
Acumulado no ano					593.428,62	5,42%	3,86%	140,24%	

Acumulado no Ano

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(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	842.845,50	0,00	0,00	850.619,19	7.773,69	0,92%	0,02%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.647.165,55	27.484,83	0,00	4.716.560,84	41.910,46	0,90%	0,96%	0,90%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	750.083,20	240.102,65	218.751,53	778.572,29	7.137,97	0,72%	0,01%	0,82%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	366.497,00	0,00	0,00	367.933,78	1.436,78	0,39%	3,87%	0,39%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.331.113,67	0,00	0,00	2.336.916,03	5.802,36	0,25%	6,39%	0,25%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.622.526,24	0,00	0,00	1.603.101,43	-19.424,81	-1,20%	13,32%	-1,20%
Total Renda Fixa					44.636,45	0,42%	3,97%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	384.859,76	0,00	0,00	389.381,26	4.521,50	1,17%	1,29%	1,17%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	203.000,00	0,00	0,00	202.000,00	-1.000,00	-0,49%	7,71%	-0,49%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	303.902,94	0,00	0,00	300.851,16	-3.051,78	-1,00%	17,85%	-1,00%
Total Renda Variável					469,72	0,05%	8,33%	