

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.

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	26.187.385,12	28,37%	1.181	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	49.229.827,81	53,33%	1.347	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.850.878,31	8,50%	596	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.800.784,40	3,03%	786	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.282.355,05	1,39%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	896.653,10	0,97%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.736.280,57	4,05%		26,91%	Artigo 8º, Inciso VI
Total para cálculo dos limites da Resolução			91.984.164,36				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			328.863,33				Artigo 6º
Total			92.313.027,69				

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%	75.417.212,93	81,99%	50,00%	70,00%	100,00%	16.566.951,43
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	11.934.017,76	12,97%	5,00%	10,00%	30,00%	15.661.231,55
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	13.797.624,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.599.208,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	896.653,10	0,97%	0,00%	2,50%	5,00%	3.702.555,12
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.599.208,22
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.736.280,57	4,06%	0,00%	5,00%	5,00%	862.927,65
DF - Artigo 6º	100,00%	328.863,33	0,36%	0,00%	0,00%	0,00%	-328.863,33
Total Carteira		92.313.027,69					

RENDA FIXA	88.576.747,12	95,95%
RENDA VARIÁVEL	3.736.280,57	4,05%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	75.417.212,93	81,70%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	11.934.017,76	12,93%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	896.653,10	0,97%	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	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.736.280,57	4,05%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	328.863,33	0,36%	0,00%	0,00%
Total	92.313.027,69	100,00%	67,00	270,00

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 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	14,07%	29,23%	0,10%	0,297%	0,32%
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	1,08%	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 PREVIDENCIÁRIO	1,01%	1,01%	3,08%	6,40%	13,15%	27,30%	1,00%	0,011%	0,08%
IPCA	0,38%	0,38%	0,86%	1,65%	5,35%	16,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,93%	0,93%	2,89%	5,90%	13,57%	-	0,20%	0,736%	2,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	0,91%	2,37%	4,94%	12,42%	31,82%	0,20%	0,041%	0,34%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	-	-	-	-	-	-	1,80%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	50.126.480,91	54,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.121.402,88	41,30%
Planner Corretora	3.736.280,57	4,05%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	328.863,33	0,36%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	75.417.212,93	81,70%
CDI	10.651.662,71	11,54%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.736.280,57	4,05%
IMA-B 5	1.282.355,05	1,39%
CRÉDITO PRIVADO	896.653,10	0,97%
DISP. FINANCEIRA	328.863,33	0,36%

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	79.513.976,61	7.195.676,69	0,00	87.664.986,82	955.333,52	1,10%	0,89%	123,53%	0,26%
Acumulado no ano					955.333,52	1,10%	0,89%	123,53%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	48.617.865,31	0,00	0,00	49.229.827,81	611.962,50	1,26%	0,29%	1,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.966.704,22	5.985.781,31	20.000,00	26.187.385,12	254.899,59	0,98%	0,30%	1,26%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	888.370,70	0,00	0,00	896.653,10	8.282,40	0,93%	0,74%	0,93%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.075.049,87	703.713,84	0,00	7.850.878,31	72.114,60	0,93%	0,01%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,16	0,00	0,00	1.282.355,05	11.555,89	0,91%	0,04%	0,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.679.019,34	1.106.304,21	3.494,30	2.800.784,40	18.955,15	0,68%	0,02%	1,10%
Total Renda Fixa					977.770,13	1,12%	0,26%	

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(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.714.615,49	0,00	0,00	3.736.280,57	21.665,08	0,58%	-	0,59%
Total Renda Variável					21.665,08	0,58%	0,00%	