

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.

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 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	24.854.488,06	26,28%	1.177	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	49.719.349,13	52,57%	1.341	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.255.623,20	1,33%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.924.602,68	8,38%	599	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.871.316,79	3,04%	776	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	905.094,40	0,96%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.753.398,25	3,97%		26,91%	Artigo 8º, Inciso VI
Total para cálculo dos limites da Resolução			91.283.872,51				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.297.031,42				Artigo 6º
Total			94.580.903,93				

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%	74.573.837,19	81,69%	50,00%	70,00%	100,00%	16.710.035,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	12.051.542,67	13,20%	5,00%	10,00%	30,00%	15.333.619,08
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	13.692.580,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.564.193,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	905.094,40	0,99%	0,00%	2,50%	5,00%	3.659.099,23
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.564.193,63
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.753.398,25	4,11%	0,00%	5,00%	5,00%	810.795,38
DF - Artigo 6º	100,00%	3.297.031,42	3,61%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.297.031,42
Total Carteira		94.580.903,93					

RENDA FIXA	90.827.505,68	96,03%
RENDA VARIÁVEL	3.753.398,25	3,97%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	74.573.837,19	78,85%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	12.051.542,67	12,74%	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 '	905.094,40	0,96%	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	3.753.398,25	3,97%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	3.297.031,42	3,49%	0,00%	0,00%
Total	94.580.903,93	100,00%	67,00	270,00

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
IRF-M 1	1,01%	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%
CDI	0,86%	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 PREVIDENCIÁRIO	0,80%	1,83%	2,90%	6,03%	13,03%	27,35%	1,00%	0,007%	0,08%
IPCA	0,33%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94%	1,88%	3,12%	5,03%	13,46%	-	0,20%	0,441%	1,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,65%	2,36%	4,56%	11,44%	30,87%	0,20%	0,152%	0,26%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	50.624.443,53	53,53%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.906.030,73	39,02%
Planner Corretora	3.753.398,25	3,97%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.297.031,42	3,49%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	74.573.837,19	78,85%
CDI	10.795.919,47	11,41%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.753.398,25	3,97%
DISP. FINANCEIRA	3.297.031,42	3,49%
IMA-B 5	1.255.623,20	1,33%
CRÉDITO PRIVADO	905.094,40	0,96%

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%
Fevereiro	87.664.986,82	113.647,81	1.620.018,05	86.977.912,77	819.296,19	0,93%	0,75%	124,87%	0,08%
Acumulado no ano					1.774.629,71	2,05%	1,65%	124,26%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.229.827,81	0,00	0,00	49.719.349,13	489.521,32	0,99%	0,08%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.187.385,12	200,00	1.580.156,77	24.854.488,06	247.059,71	0,94%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	896.653,10	0,00	0,00	905.094,40	8.441,30	0,94%	0,44%	0,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.800.784,40	102.914,60	57.837,25	2.871.316,79	25.455,04	0,88%	0,02%	0,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.850.878,31	10.533,21	0,00	7.924.602,68	63.191,16	0,80%	0,01%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.282.355,05	0,00	35.975,08	1.255.623,20	9.243,23	0,72%	0,15%	0,73%
Total Renda Fixa					842.911,76	0,96%	0,08%	

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(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.736.280,57	0,00	0,00	3.753.398,25	17.117,68	0,46%	-	0,46%
				Total Renda Variável	17.117,68	0,46%	0,00%	