

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.

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 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	24.592.822,96	25,37%	1.170	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	50.273.352,91	51,85%	1.342	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.902.112,70	8,15%	604	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.881.900,02	1,94%	762	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.266.072,76	1,31%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	916.220,20	0,95%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.765.270,25	3,88%		22,29%	Artigo 8º, Inciso VI
Total para cálculo dos limites da Resolução			90.597.751,80				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.355.642,90				Artigo 6º
Total			96.953.394,70				

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%	74.866.175,87	82,64%	50,00%	70,00%	100,00%	15.731.575,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	11.050.085,48	12,20%	5,00%	10,00%	30,00%	16.129.240,06
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	13.589.662,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.529.887,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	916.220,20	1,01%	0,00%	2,50%	5,00%	3.613.667,39
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.529.887,59
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.765.270,25	4,16%	0,00%	5,00%	5,00%	764.617,34
DF - Artigo 6º	100,00%	6.355.642,90	7,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.355.642,90
Total Carteira		96.953.394,70					

RENDA FIXA	93.188.124,45	96,12%
RENDA VARIÁVEL	3.765.270,25	3,88%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	74.866.175,87	77,22%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	11.050.085,48	11,40%	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 '	916.220,20	0,95%	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	3.765.270,25	3,88%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	6.355.642,90	6,56%	0,00%	0,00%
Total	96.953.394,70	100,00%	67,00	270,00

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	1,12%	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,39%	3,39%	6,65%	13,82%	29,85%	0,10%	0,130%	0,30%
CDI	1,05%	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 PREVIDENCIÁRIO	0,97%	2,82%	2,82%	5,95%	12,94%	27,36%	1,00%	0,000%	0,09%
IPCA	0,25%	0,96%	0,96%	1,71%	4,57%	14,39%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,23%	3,13%	3,13%	5,32%	12,16%	-	0,20%	0,450%	1,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	2,49%	2,49%	4,59%	11,05%	29,29%	0,20%	0,140%	0,26%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	51.189.573,11	52,80%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.642.908,44	36,76%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	6.355.642,90	6,56%
Planner Corretora	3.765.270,25	3,88%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	74.866.175,87	77,22%
CDI	9.784.012,72	10,09%
DISP. FINANCEIRA	6.355.642,90	6,56%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.765.270,25	3,88%
IMA-B 5	1.266.072,76	1,31%
CRÉDITO PRIVADO	916.220,20	0,95%

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%
Março	86.977.912,77	0,00	1.533.922,89	86.355.649,26	911.659,38	1,05%	0,78%	133,60%	0,12%
Acumulado no ano					2.686.289,09	3,12%	2,44%	127,48%	

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(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	905.094,40	0,00	0,00	916.220,20	11.125,80	1,23%	0,45%	1,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.719.349,13	0,00	0,00	50.273.352,91	554.003,78	1,11%	0,13%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.854.488,06	0,00	532.229,46	24.592.822,96	270.564,36	1,09%	0,13%	1,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.924.602,68	0,00	98.852,01	7.902.112,70	76.362,03	0,96%	0,00%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.255.623,20	0,00	0,00	1.266.072,76	10.449,56	0,83%	0,14%	0,83%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.871.316,79	0,00	1.012.930,94	1.881.900,02	23.514,17	0,82%	0,01%	1,07%
Total Renda Fixa					946.019,70	1,08%	0,12%	

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(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.753.398,25	0,00	0,00	3.765.270,25	11.872,00	0,32%	-	0,32%
				Total Renda Variável	11.872,00	0,32%	0,00%	

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	48.617.865,31	0,00	0,00	50.273.352,91	1.655.487,60	3,41%	3,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.966.704,22	5.985.981,31	2.132.386,23	24.592.822,96	772.523,66	3,04%	3,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.075.049,87	714.247,05	98.852,01	7.902.112,70	211.667,79	2,72%	2,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.679.019,34	1.209.218,81	1.074.262,49	1.881.900,02	67.924,36	2,39%	3,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,16	0,00	35.975,08	1.266.072,76	31.248,68	2,48%	2,49%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	888.370,70	0,00	0,00	916.220,20	27.849,50	3,13%	3,13%
Total Renda Fixa					2.766.701,59	3,19%	

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 (%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.714.615,49	0,00	0,00	3.765.270,25	50.654,76	1,36%	-
				Total Renda Variável	50.654,76	1,36%	