

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.

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 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	27.945.839,84	28,17%	1.168	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	50.706.911,56	51,11%	1.339	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.273.850,34	1,28%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.279.808,99	3,31%	608	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.386.588,68	2,41%	754	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	922.799,50	0,93%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.777.882,35	3,81%		22,29%	Artigo 8º, Inciso VI
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	4.999.915,99	5,04%	6	23,56%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			95.293.597,25				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.921.771,28	Artigo 6º			
Total			99.215.368,53				

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%	78.652.751,40	82,54%	50,00%	70,00%	100,00%	16.640.845,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	6.940.248,01	7,28%	5,00%	10,00%	30,00%	21.647.831,17
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	14.294.039,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.764.679,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	922.799,50	0,97%	0,00%	2,50%	5,00%	3.841.880,36
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.764.679,86
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.777.882,35	3,96%	0,00%	5,00%	5,00%	986.797,51
Desenquadrado - RF	0,00%	4.999.915,99	5,25%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.999.915,99
DF - Artigo 6º	100,00%	3.921.771,28	4,12%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.921.771,28
Total Carteira		99.215.368,53					

RENDA FIXA	95.437.486,18	96,19%
RENDA VARIÁVEL	3.777.882,35	3,81%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	78.652.751,40	79,27%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.940.248,01	7,00%	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 '	922.799,50	0,93%	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	3.777.882,35	3,81%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	4.999.915,99	5,04%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	3.921.771,28	3,95%	0,00%	0,00%
Total	99.215.368,53	100,00%	67,00	270,00

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	0,87%	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
CDI	0,79%	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 PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
IPCA	0,14%	1,10%	0,72%	1,59%	4,08%	13,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,72%	3,88%	2,92%	5,89%	12,24%	31,20%	0,20%	0,277%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	3,12%	2,19%	4,61%	10,72%	28,49%	0,20%	0,027%	0,26%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,47%	3,58%	2,59%	-	-	-	0,90%	0,446%	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	51.629.711,06	52,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.886.087,85	35,16%
RJI CORRETORA DE VALORES	4.999.915,99	5,04%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.921.771,28	3,95%
Planner Corretora	3.777.882,35	3,81%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	78.652.751,40	79,27%
CDI	5.666.397,67	5,71%
IMA-B	4.999.915,99	5,04%
DISP. FINANCEIRA	3.921.771,28	3,95%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.777.882,35	3,81%
IMA-B 5	1.273.850,34	1,28%
CRÉDITO PRIVADO	922.799,50	0,93%

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%
Abril	86.355.649,26	10.363.686,69	6.721.645,17	90.713.809,11	716.118,33	0,80%	0,56%	142,69%	0,17%
Acumulado no ano					3.402.407,42	3,94%	3,02%	130,54%	

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	50.273.352,91	0,00	0,00	50.706.911,56	433.558,65	0,86%	0,16%	0,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.592.822,96	4.747.514,52	1.626.898,33	27.945.839,84	232.400,69	0,79%	0,16%	0,86%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	916.220,20	0,00	0,00	922.799,50	6.579,30	0,72%	0,28%	0,72%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.881.900,02	730.940,42	244.623,38	2.386.588,68	18.371,62	0,70%	0,01%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.266.072,76	0,00	0,00	1.273.850,34	7.777,58	0,61%	0,03%	0,61%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.902.112,70	458.156,88	5.122.635,84	3.279.808,99	42.175,25	0,50%	0,01%	0,73%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.999.915,99	-84,01	0,00%	0,45%	0,47%
Total Renda Fixa					740.779,08	0,82%	0,17%	

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(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.765.270,25	0,00	0,00	3.777.882,35	12.612,10	0,33%	-	0,33%
Total Renda Variável					12.612,10	0,33%	0,00%	