

# 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.

## Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	508.784,58	0,50%	181	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.460.424,90	28,08%	1.184	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	51.163.984,75	50,49%	1.348	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.284.521,79	1,27%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.257.715,29	4,20%	611	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.048.718,87	3,99%	761	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	928.944,80	0,92%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.792.489,70	3,74%		22,29%	Artigo 8º, Inciso VI
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	5.005.237,16	4,94%	6	21,43%	Desenquadrado - RF
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>99.450.821,84</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.894.019,26				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>101.344.841,10</b>				



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	80.133.194,23	79,07%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	9.590.955,95	9,46%	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 '	928.944,80	0,92%	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	3.792.489,70	3,74%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	5.005.237,16	4,94%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	1.894.019,26	1,87%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>101.344.841,10</b>	<b>100,00%</b>	<b>67,00</b>	<b>270,00</b>

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+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	7,21%	1,96%	9,44%	19,17%	36,79%	0,20%	8,320%	6,49%
IRF-M 1	0,89%	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	5,20%	2,87%	6,42%	13,36%	29,82%	0,10%	0,964%	0,66%
CDI	0,81%	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 PREVIDENCIÁRIO	0,82%	4,42%	2,54%	5,52%	12,44%	27,01%	1,00%	0,007%	0,10%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	0,11%	3,69%	1,64%	-	-	-	0,90%	3,273%	-
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	3,99%	2,30%	4,72%	10,30%	27,93%	0,20%	0,060%	0,24%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,67%	4,57%	2,64%	5,83%	11,32%	30,93%	0,20%	1,785%	1,74%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	52.601.714,13	51,90%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.051.380,85	37,55%
RJI CORRETORA DE VALORES	5.005.237,16	4,94%
Planner Corretora	3.792.489,70	3,74%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.894.019,26	1,87%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	79.624.409,65	78,57%
CDI	8.306.434,16	8,20%
IMA-B	5.005.237,16	4,94%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.792.489,70	3,74%
DISP. FINANCEIRA	1.894.019,26	1,87%
IMA-B 5	1.284.521,79	1,27%
CRÉDITO PRIVADO	928.944,80	0,92%
IRF-M 1+	508.784,58	0,50%

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%
Mai	90.713.809,11	5.114.852,71	1.935.296,28	94.652.475,28	759.109,74	0,81%	0,82%	98,41%	1,03%
Acumulado no ano					4.161.517,16	4,78%	3,86%	123,69%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	50.706.911,56	0,00	0,00	51.163.984,75	457.073,19	0,90%	0,96%	0,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.945.839,84	320.000,00	54.000,00	28.460.424,90	248.585,06	0,88%	0,96%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.273.850,34	0,00	0,00	1.284.521,79	10.671,45	0,84%	0,06%	0,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.279.808,99	1.358.143,61	415.974,05	4.257.715,29	35.736,74	0,77%	0,01%	0,82%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	922.799,50	0,00	0,00	928.944,80	6.145,30	0,67%	1,79%	0,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.386.588,68	3.155.142,02	1.519.322,23	4.048.718,87	26.310,40	0,47%	0,02%	0,92%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	4.999.915,99	0,00	0,00	5.005.237,16	5.321,17	0,11%	3,27%	0,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	512.409,58	0,00	508.784,58	-3.625,00	-0,71%	8,32%	0,09%
Total Renda Fixa					786.218,31	0,83%	1,03%	

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(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.777.882,35	0,00	0,00	3.792.489,70	14.607,35	0,39%	-	0,39%
Total Renda Variável					14.607,35	0,39%	0,00%	