

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016



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 (novembro / 2016)

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	35.103.575,11	40,90%	1.175	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	33.160.092,82	38,64%	1.346	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.261.891,02	1,47%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.473.086,17	2,88%	796	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.088.946,42	8,26%	589	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	877.733,50	1,02%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.712.433,71	4,33%		26,91%	Artigo 8º, Inciso VI
Total para cálculo dos limites da Resolução			83.677.758,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.139.798,40				Artigo 6º
Total			85.817.557,15				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (novembro / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	70,00%	68.263.667,93	81,58%	-9.689.236,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	16.735.551,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	10.823.923,61	12,94%	-10.823.923,61
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.183.887,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	877.733,50	1,05%	-877.733,50
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	79.965.325,04	95,56%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.712.433,71	4,44%	471.454,23
Total	30,00%	5,00	3.712.433,71	4,44%	

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,05%	13,36%	3,22%	6,67%	14,70%	29,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,17%	6,58%	14,56%	28,82%	0,20%	0,124%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	13,16%	3,15%	6,52%	14,47%	28,52%	0,10%	0,124%	0,35%
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	12,60%	3,27%	6,87%	13,93%	29,05%	0,20%	0,017%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	11,93%	3,04%	6,56%	13,15%	26,92%	1,00%	0,008%	0,08%
IPCA	0,18%	5,97%	0,52%	1,84%	6,99%	18,20%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	12,25%	2,15%	5,33%	14,09%	33,23%	0,20%	0,054%	0,36%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,72%	15,45%	1,85%	5,19%	15,97%	-	0,20%	0,948%	2,88%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2016)

	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 (novembro / 2016)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.927.498,72	54,89%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.037.826,32	40,68%
Planner Corretora	3.712.433,71	4,44%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.139.798,40	2,56%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	68.263.667,93	81,58%
CDI	9.562.032,59	11,43%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.712.433,71	4,44%
DISP. FINANCEIRA	2.139.798,40	2,56%
IMA-B 5	1.261.891,02	1,51%
CRÉDITO PRIVADO	877.733,50	1,05%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	58.708.476,58	3.081.427,72	1.097.949,17	61.646.872,08	954.916,95	1,57%	1,74%	90,46%	0,36%
Fevereiro	61.646.872,08	59.676,04	1.795.860,61	60.561.416,85	650.729,34	1,06%	1,34%	78,52%	0,82%
Março	60.561.416,85	4.332.009,80	0,00	65.626.375,48	732.948,83	1,13%	0,94%	119,88%	0,19%
Abril	65.626.375,48	2.231.176,28	1.203.775,17	67.328.651,88	674.875,29	1,01%	1,08%	94,07%	0,18%
Mai	67.328.651,88	2.120.208,24	1.193.264,40	68.992.810,97	737.215,25	1,08%	1,27%	85,01%	0,10%
Junho	68.992.810,97	2.598.697,24	1.228.190,56	71.114.317,02	750.999,37	1,07%	0,86%	123,85%	0,13%
Julho	71.114.317,02	3.078.695,92	1.746.887,72	73.173.739,45	727.614,23	1,00%	1,01%	99,51%	0,10%
Agosto	73.173.739,45	11.930.006,13	10.453.857,97	75.508.035,75	858.148,14	1,15%	0,98%	117,83%	0,06%
Setembro	75.508.035,75	3.029.735,34	1.478.749,59	77.911.740,08	852.718,58	1,11%	0,57%	195,11%	0,07%
Outubro	77.911.740,08	267.366,14	3.198.899,06	75.695.123,55	714.916,39	0,92%	0,72%	126,61%	0,16%
Novembro	75.695.123,55	7.328.125,55	3.752.689,62	80.037.794,30	767.234,82	0,97%	0,64%	150,21%	0,12%
Acumulado no ano					8.422.317,19	12,75%	11,73%	108,64%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.452.355,01	368,38	5.308,69	2.473.086,17	25.671,47	1,05%	0,02%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.823.581,81	0,00	0,00	33.160.092,82	336.511,01	1,03%	0,12%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.652.631,31	2.917.455,27	3.820.876,14	35.103.575,11	354.364,67	0,92%	0,12%	1,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.051.967,90	977.681,90	0,00	7.088.946,42	59.296,62	0,84%	0,01%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.252.696,45	0,00	0,00	1.261.891,02	9.194,57	0,73%	0,05%	0,73%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	871.435,60	0,00	0,00	877.733,50	6.297,90	0,72%	0,95%	0,72%
				Total Renda Fixa	791.336,24	1,00%	0,12%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,00	3.700.000,00	0,00	3.712.433,71	12.433,71	0,34%	-	0,00%
Total Renda Variável					12.433,71	0,34%	0,00%	