

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 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	19.966.704,22	22,41%	1.183	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	48.617.865,31	54,57%	1.340	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.270.799,16	1,43%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.075.049,87	7,94%	588	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.679.019,34	1,88%	787	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	888.370,70	1,00%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	3.714.615,49	4,17%		26,91%	Artigo 8º, Inciso VI
Total para cálculo dos limites da Resolução			83.212.424,09				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.887.176,37				Artigo 6º
Total			89.099.600,46				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	70,00%	68.584.569,53	82,42%	-10.335.872,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	16.642.484,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	10.024.868,37	12,05%	-10.024.868,37
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.160.621,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	888.370,70	1,07%	-888.370,70
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	79.497.808,60	95,54%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.714.615,49	4,46%	446.005,71
Total	30,00%	5,00	3.714.615,49	4,46%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,20%	14,72%	3,22%	6,79%	14,72%	29,64%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	14,58%	3,18%	6,71%	14,58%	29,20%	0,20%	0,098%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	14,48%	3,16%	6,66%	14,48%	28,89%	0,10%	0,100%	0,35%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,13%	13,88%	3,28%	6,94%	13,88%	29,21%	0,20%	0,009%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	13,11%	3,05%	6,44%	13,11%	27,10%	1,00%	0,007%	0,08%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,21%	16,84%	2,12%	5,31%	16,84%	-	0,20%	0,602%	2,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	13,04%	2,05%	4,90%	13,04%	32,57%	0,20%	0,185%	0,36%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	49.506.236,01	59,49%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.991.572,59	36,04%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.887.176,37	7,07%
Planner Corretora	3.714.615,49	4,46%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	68.584.569,53	82,42%
CDI	8.754.069,21	10,52%
DISP. FINANCEIRA	5.887.176,37	7,07%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.714.615,49	4,46%
IMA-B 5	1.270.799,16	1,53%
CRÉDITO PRIVADO	888.370,70	1,07%

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%
Dezembro	80.037.794,30	15.020.580,33	16.420.122,68	79.513.976,61	875.724,66	1,09%	0,81%	134,83%	0,10%
Acumulado no ano					9.298.041,85	13,98%	12,64%	110,61%	

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

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	877.733,50	0,00	0,00	888.370,70	10.637,20	1,21%	0,60%	1,21%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.088.946,42	4.116,26	92.296,54	7.075.049,87	74.283,73	1,05%	0,01%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.473.086,17	21.232,41	840.000,00	1.679.019,34	24.700,76	0,99%	0,01%	1,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.103.575,11	11.692,30	15.487.826,14	19.966.704,22	339.262,95	0,97%	0,10%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.160.092,82	15.000.000,00	0,00	48.617.865,31	457.772,49	0,95%	0,10%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.261.891,02	0,00	0,00	1.270.799,16	8.908,14	0,71%	0,18%	0,71%
Total Renda Fixa					915.565,27	1,14%	0,10%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	3.712.433,71	0,00	0,00	3.714.615,49	2.181,78	0,06%	-	0,00%
Total Renda Variável					2.181,78	0,06%	0,00%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.516.871,63	15.000.000,00	0,00	48.617.865,31	1.100.993,68	2,95%	3,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.824.182,00	3.103.673,53	20.988.163,01	19.966.704,22	1.027.011,70	2,81%	3,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.086.471,16	1.023.212,25	228.332,39	7.075.049,87	193.698,85	2,90%	3,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.988.077,37	73.907,29	2.474.125,99	1.679.019,34	91.160,67	3,08%	3,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.245.327,03	0,00	0,00	1.270.799,16	25.472,13	2,05%	2,05%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	869.923,60	0,00	0,00	888.370,70	18.447,10	2,12%	2,12%
Total Renda Fixa					2.456.784,13	3,10%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,00	3.700.000,00	0,00	3.714.615,49	14.615,49	0,40%	-
Total Renda Variável					14.615,49	0,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.213.337,80	20.796.857,75	31.166.296,04	19.966.704,22	4.122.804,71	13,24%	14,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.757.156,48	24.291.477,00	0,00	48.617.865,31	3.569.231,83	14,12%	14,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.163.266,86	4.724.134,76	425.805,47	7.075.049,87	613.453,72	12,14%	13,11%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.398.420,00	0,00	5.880.103,24	0,00	481.683,24	9,10%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.735.269,33	3.876.485,98	4.277.652,52	1.679.019,34	344.916,55	11,69%	13,88%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.131.172,00	0,00	3.410.417,03	0,00	279.245,03	9,10%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.191.050,40	0,00	70.702,69	1.270.799,16	150.451,45	13,00%	13,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	760.303,60	0,00	0,00	888.370,70	128.067,10	16,84%	16,84%
				Total Renda Fixa	9.689.853,63	14,06%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,00	3.700.000,00	0,00	3.714.615,49	14.615,49	0,40%	-
				Total Renda Variável	14.615,49	0,40%	