

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	418.553,96	0,50%	616	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.801.986,59	6,99%	1.181	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.577.552,78	7,92%	714	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.087.820,78	8,54%	730	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.838.806,76	3,42%	216	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	580.911,09	0,70%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	568.235,96	0,68%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.095.403,46	2,52%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.328.795,76	12,44%	1.347	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.321.112,41	16,04%	604	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	156.394,00	0,19%	200	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.130.890,53	8,59%	194	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.817.170,08	16,64%	728	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.186.634,35	12,27%	619	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	984.690,95	1,19%	190	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.144.767,63	1,38%	596	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV
Total			83.039.727,09				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	80.910.268,51	97,44%	30,00%	35,00%	70,00%	-22.782.459,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	49.823.836,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	24.911.918,13
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.455.959,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.151.986,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.151.986,35
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.455.959,06
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.151.986,35
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.151.986,35
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.151.986,35
Total Carteira		80.910.268,51					

RENDA FIXA	83.039.727,09	102,63%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	80.910.268,51	97,44%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	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 '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
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%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	80.910.268,51	97,44%	66,00	215,00

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	2,284%	2,28%	4,50%	8,90%	22,76%	32,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,31%	2,31%	4,44%	8,91%	22,88%	32,11%	0,20%	1,506%	3,60%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	2,29%	4,44%	8,85%	22,68%	32,25%	0,20%	1,492%	3,59%
IMA-B 5+	2,237%	2,24%	3,87%	7,30%	32,37%	36,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,18%	2,18%	3,79%	7,13%	31,98%	35,25%	0,20%	4,406%	10,58%
IMA-B	1,867%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	1,84%	3,47%	6,69%	24,54%	33,54%	0,20%	3,342%	7,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,84%	1,84%	3,55%	6,75%	24,64%	32,05%	0,20%	3,342%	7,48%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	2,78%	2,90%	6,25%	-	0,20%	0,847%	4,79%
IMA Geral	1,804%	1,80%	3,72%	7,35%	20,74%	31,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	1,76%	3,74%	7,51%	20,69%	31,16%	0,20%	1,571%	3,69%
IRF-M 1	1,289%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	14,07%	29,23%	0,10%	0,297%	0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
IMA-B 5	1,156%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%
IDKA IPCA 2 Anos	1,087%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,08%	2,89%	6,06%	12,74%	31,45%	0,20%	1,089%	2,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	2,89%	5,98%	12,92%	31,70%	0,20%	1,042%	2,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	1,01%	2,84%	5,36%	12,37%	-	0,20%	0,835%	1,23%
CDI	1,085%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,01%	1,01%	3,08%	6,40%	13,15%	27,30%	1,00%	0,011%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,01%	1,01%	3,07%	6,35%	13,09%	27,15%	0,80%	0,010%	0,02%
IPCA	0,380%	0,38%	0,86%	1,65%	5,35%	16,63%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	1,13%	2,87%	5,67%	13,71%	-	0,20%	1,475%	2,62%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	45.859.821,87	55,23%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.179.905,22	44,77%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	24.584.715,52	29,61%
IMA-B	20.408.933,19	24,58%
IRF-M 1	16.130.782,35	19,43%
IRF-M	7.549.444,49	9,09%
IMA-B 5	7.145.788,74	8,61%
IMA-B 5+	2.838.806,76	3,42%
CDI	2.129.458,58	2,56%
IPCA	2.095.403,46	2,52%
IMA-GERAL	156.394,00	0,19%

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	82.463.526,96	9.478,48	627.121,88	83.039.727,09	1.193.843,53	1,45%	0,89%	162,31%	1,63%
Acumulado no ano					1.193.843,53	1,45%	0,89%	162,31%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.970.167,57	0,00	0,00	7.130.890,53	160.722,96	2,31%	1,51%	2,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	409.165,98	0,00	0,00	418.553,96	9.387,98	2,29%	1,49%	2,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.778.371,47	0,00	0,00	2.838.806,76	60.435,29	2,18%	4,41%	2,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.079.880,70	0,00	0,00	13.321.112,41	241.231,71	1,84%	3,34%	1,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.959.585,16	0,00	0,00	7.087.820,78	128.235,62	1,84%	3,34%	1,84%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	153.696,14	0,00	0,00	156.394,00	2.697,86	1,76%	1,57%	1,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.729.791,12	0,00	0,00	5.801.986,59	72.195,47	1,26%	0,30%	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.200.401,33	0,00	0,00	10.328.795,76	128.394,43	1,26%	0,29%	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.503.570,06	0,00	0,00	6.577.552,78	73.982,72	1,14%	1,25%	1,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.072.054,91	0,00	0,00	2.095.403,46	23.348,55	1,13%	1,48%	1,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.669.107,90	0,00	0,00	13.817.170,08	148.062,18	1,08%	1,09%	1,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.079.404,92	0,00	0,00	10.186.634,35	107.229,43	1,06%	1,04%	1,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	974.318,88	482,94	0,00	984.690,95	9.889,13	1,01%	0,01%	1,01%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	562.573,18	0,00	0,00	568.235,96	5.662,78	1,01%	0,85%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	575.127,40	0,00	0,00	580.911,09	5.783,69	1,01%	0,84%	1,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.746.310,24	8.995,54	627.121,88	1.144.767,63	16.583,73	0,94%	0,01%	1,01%
Total Renda Fixa					1.193.843,53	1,45%	1,63%	