

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 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	36.243.067,53	60,72%	1.177	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.149.384,12	3,60%	40	1,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.995.810,73	10,05%	1.341	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	535.443,74	0,90%	156	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	59.450,88	0,10%	776	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.559.175,50	7,64%	764	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.573.777,90	14,36%	2.446	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.552.710,41	2,60%	37	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			59.668.820,81				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			18.216,07	Artigo 6º			
Total			59.687.036,88				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	44.923.706,12	75,29%	50,00%	70,00%	100,00%	14.745.114,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	35.801.292,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	35.801.292,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	14.745.114,69	24,71%	0,00%	0,00%	30,00%	3.155.531,55
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	8.950.323,12
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	14.917.205,20
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.983.441,04
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.983.441,04
DF - Artigo 6º	100,00%	18.216,07	0,03%	0,00%	0,00%	0,00%	-18.216,07
Total Carteira		59.687.036,88					

RENTA FIXA	59.687.036,88	100,00%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	44.923.706,12	75,27%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	14.745.114,69	24,70%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	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 I	0,00	0,00%	0,00%	25,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	18.216,07	0,03%	0,00%	0,00%
Total	59.687.036,88	100,00%	0,00	475,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3,47%	5,28%	8,11%	9,11%	23,72%	36,06%	0,20%	1,626%	6,54%

IRF-M 1+	2,37%	5,09%	7,31%	11,32%	28,78%	37,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,40%	5,16%	7,35%	11,36%	28,98%	37,66%	0,20%	1,255%	5,29%

IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%

CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,89%	1,96%	3,07%	5,81%	12,98%	27,90%	0,50%	0,059%	0,29%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	2,00%	3,16%	6,52%	13,85%	29,49%	0,20%	0,015%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	1,96%	3,09%	6,43%	13,90%	29,43%	0,20%	0,044%	0,05%

IPCA	0,33%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,56%	2,73%	4,06%	-	-	-	0,20%	0,944%	-

Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
--------------	---	---	---	---	---	---	---	---	---

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.302.518,41	60,82%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.643.140,38	21,18%
Santander Securities Services	10.723.162,02	17,97%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	18.216,07	0,03%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	42.238.878,26	70,77%
CDI	13.192.404,28	22,10%
IMA-B	2.149.384,12	3,60%
GESTÃO DURATION	1.552.710,41	2,60%
IRF-M 1+	535.443,74	0,90%
DISP. FINANCEIRA	18.216,07	0,03%

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	57.633.174,85	0,00	233.782,97	58.115.238,99	715.847,11	1,24%	0,89%	139,26%	0,37%
Fevereiro	58.115.238,99	1.153.317,10	233.351,97	59.668.820,81	633.616,69	1,07%	0,75%	143,40%	0,17%
Acumulado no ano					1.349.463,80	2,33%	1,65%	141,39%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.077.214,05	0,00	0,00	2.149.384,12	72.170,07	3,47%	1,63%	3,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	522.903,21	0,00	0,00	535.443,74	12.540,53	2,40%	1,26%	2,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.528.913,95	0,00	0,00	1.552.710,41	23.796,46	1,56%	0,94%	1,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.936.777,83	0,00	0,00	5.995.810,73	59.032,90	0,99%	0,08%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.973.208,31	1.153.317,10	233.351,97	36.243.067,53	349.894,09	0,97%	0,08%	0,99%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.497.909,54	0,00	0,00	8.573.777,90	75.868,36	0,89%	0,06%	0,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	58.925,50	0,00	0,00	59.450,88	525,38	0,89%	0,02%	0,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.519.386,60	0,00	0,00	4.559.175,50	39.788,90	0,88%	0,04%	0,88%
Total Renda Fixa					633.616,69	1,07%	0,17%	