

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 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	34.973.208,31	59,63%	1.181	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.077.214,05	3,54%	40	1,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.936.777,83	10,12%	1.347	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	522.903,21	0,89%	122	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	58.925,50	0,10%	786	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.519.386,60	7,71%	770	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.497.909,54	14,49%	2.434	0,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.528.913,95	2,61%	34	0,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			58.115.238,99				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			530.988,65	Artigo 6º			
Total			58.646.227,64				

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%	43.510.103,40	74,87%	50,00%	70,00%	100,00%	14.605.135,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	34.869.143,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	34.869.143,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	14.605.135,59	25,13%	0,00%	0,00%	30,00%	2.829.436,11
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	8.717.285,85
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	14.528.809,75
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.905.761,95
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.905.761,95
DF - Artigo 6º	100,00%	530.988,65	0,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-530.988,65
Total Carteira		58.646.227,64					

RENTA FIXA	58.646.227,64	100,00%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 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 '	43.510.103,40	74,19%	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 '	14.605.135,59	24,90%	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	530.988,65	0,91%	0,00%	0,00%
Total	58.646.227,64	100,00%	0,00	475,00

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 1+	2,66%	2,66%	4,86%	9,69%	28,23%	34,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,69%	2,69%	4,78%	9,72%	28,55%	34,45%	0,20%	1,972%	5,47%

IMA-B	1,87%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,74%	1,74%	3,38%	6,57%	22,25%	32,09%	0,20%	2,957%	6,65%

IRF-M 1	1,29%	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%

CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,10%	1,10%	3,32%	6,91%	13,93%	29,41%	0,20%	0,020%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	1,07%	3,27%	6,77%	14,03%	29,36%	0,20%	0,035%	0,05%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,05%	1,05%	2,86%	6,09%	13,10%	27,79%	0,50%	0,107%	0,29%

IPCA	0,38%	0,38%	0,86%	1,65%	5,35%	16,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,15%	1,15%	-	-	-	-	0,20%	0,955%	-

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

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.032.133,81	59,73%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.507.981,59	21,33%
Santander Securities Services	10.575.123,59	18,03%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	530.988,65	0,91%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	40.909.986,14	69,76%
CDI	13.076.221,64	22,30%
IMA-B	2.077.214,05	3,54%
GESTÃO DURATION	1.528.913,95	2,61%
DISP. FINANCEIRA	530.988,65	0,91%
IRF-M 1+	522.903,21	0,89%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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%
Acumulado no ano					715.847,11	1,24%	0,89%	139,26%	

Acumulado no Ano

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 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	509.181,56	0,00	0,00	522.903,21	13.721,65	2,69%	1,97%	2,69%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.041.611,30	0,00	0,00	2.077.214,05	35.602,75	1,74%	2,96%	1,74%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.768.925,85	0,00	233.782,97	34.973.208,31	438.065,43	1,26%	0,30%	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.862.979,37	0,00	0,00	5.936.777,83	73.798,46	1,26%	0,29%	1,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.511.487,99	0,00	0,00	1.528.913,95	17.425,96	1,15%	0,95%	1,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	58.285,61	0,00	0,00	58.925,50	639,89	1,10%	0,02%	1,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.471.348,36	0,00	0,00	4.519.386,60	48.038,24	1,07%	0,03%	1,07%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.409.354,81	0,00	0,00	8.497.909,54	88.554,73	1,05%	0,11%	1,05%
Total Renda Fixa					715.847,11	1,24%	0,37%	