

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	543.583,53	0,89%	171	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	37.064.826,50	61,01%	1.170	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.171.951,54	3,58%	41	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.062.619,76	9,98%	1.342	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.607.882,08	7,58%	754	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.664.274,08	14,26%	2.482	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	60.084,98	0,10%	762	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.575.057,67	2,59%	44	0,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			60.750.280,14				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.155,15	Artigo 6º			
Total			60.751.435,29				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	45.842.981,33	75,46%	50,00%	70,00%	100,00%	14.907.298,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	36.450.168,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	36.450.168,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	14.907.298,81	24,54%	0,00%	0,00%	30,00%	3.317.785,23
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	9.112.542,02
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	15.187.570,04
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.037.514,01
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.037.514,01
DF - Artigo 6º	100,00%	1.155,15	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.155,15
Total Carteira		60.751.435,29					

RENTA FIXA	60.751.435,29	100,00%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 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 '	45.842.981,33	75,46%	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 '	14.907.298,81	24,54%	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	1.155,15	0,00%	0,00%	0,00%
Total	60.751.435,29	100,00%	0,00	475,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	3,05%	3,05%	6,39%	13,77%	29,47%	0,20%	0,030%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	3,09%	3,09%	6,47%	13,79%	29,52%	0,20%	0,010%	0,17%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,06%	3,03%	3,03%	5,80%	12,91%	27,98%	0,50%	0,060%	0,29%

IRF-M 1+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	7,21%	1,96%	9,44%	19,17%	36,79%	0,20%	8,320%	6,49%

IMA-B	1,04%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,05%	6,38%	6,38%	8,64%	19,80%	37,66%	0,20%	1,780%	5,52%

IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,24%	2,91%	6,48%	13,48%	30,10%	0,20%	0,955%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	5,20%	2,87%	6,42%	13,36%	29,82%	0,10%	0,964%	0,66%

IPCA	0,25%	0,96%	0,96%	1,71%	4,57%	14,39%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,44%	4,21%	4,21%	-	-	-	0,20%	1,480%	-

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

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.124.911,48	61,11%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.789.143,04	21,05%
Santander Securities Services	10.836.225,62	17,84%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.155,15	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	43.127.446,26	70,99%
CDI	13.332.241,14	21,95%
IMA-B	2.171.951,54	3,58%
GESTÃO DURATION	1.575.057,67	2,59%
IRF-M 1+	543.583,53	0,89%
DISP. FINANCEIRA	1.155,15	0,00%

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%
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%
Março	59.668.820,81	678.308,31	255.954,32	60.750.280,14	659.105,34	1,10%	0,78%	139,80%	0,22%
Acumulado no ano					2.008.569,14	3,45%	2,44%	141,17%	

Acumulado no Ano

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de março / 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	535.443,74	0,00	0,00	543.583,53	8.139,79	1,52%	1,75%	1,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.552.710,41	0,00	0,00	1.575.057,67	22.347,26	1,44%	1,48%	1,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.995.810,73	0,00	0,00	6.062.619,76	66.809,03	1,11%	0,13%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.243.067,53	678.308,31	255.954,32	37.064.826,50	399.404,98	1,08%	0,13%	1,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.559.175,50	0,00	0,00	4.607.882,08	48.706,58	1,07%	0,03%	1,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	59.450,88	0,00	0,00	60.084,98	634,10	1,07%	0,01%	1,07%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.573.777,90	0,00	0,00	8.664.274,08	90.496,18	1,06%	0,06%	1,06%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.149.384,12	0,00	0,00	2.171.951,54	22.567,42	1,05%	1,78%	1,05%
Total Renda Fixa					659.105,34	1,10%	0,22%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.768.925,85	1.831.625,41	723.089,26	37.064.826,50	1.187.364,50	3,35%	3,39%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.409.354,81	0,00	0,00	8.664.274,08	254.919,27	3,03%	3,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.862.979,37	0,00	0,00	6.062.619,76	199.640,39	3,41%	3,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.471.348,36	0,00	0,00	4.607.882,08	136.533,72	3,05%	3,05%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.041.611,30	0,00	0,00	2.171.951,54	130.340,24	6,38%	6,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.511.487,99	0,00	0,00	1.575.057,67	63.569,68	4,21%	4,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	509.181,56	0,00	0,00	543.583,53	34.401,97	6,76%	6,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	58.285,61	0,00	0,00	60.084,98	1.799,37	3,09%	3,09%
Total Renda Fixa					2.008.569,14	3,45%	