

Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 (abril / 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	435.418,03	0,50%	668	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.871.192,65	16,97%	284	1,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	12.425.717,39	14,18%	314	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.097.610,21	11,52%	717	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.813.800,02	7,78%	720	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	582.127,36	0,66%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	162.302,13	0,19%	206	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.113.807,81	2,41%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	45.329,15	0,05%	1.339	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	569.753,88	0,65%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.448.642,25	10,78%	769	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.286.616,14	9,46%	609	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	172.678,02	0,20%	1.168	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.926.335,31	15,89%	627	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.414.842,78	8,46%	269	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	255.141,80	0,29%	608	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.627,15	0,00%	194	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
Total			87.622.942,08				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	87.366.173,13	99,71%	30,00%	35,00%	70,00%	-26.030.113,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	52.573.765,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	26.286.882,62
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.143.441,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.381.147,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.381.147,10
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.143.441,31
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.381.147,10
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.381.147,10
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.381.147,10
Total Carteira		87.366.173,13					

RENDA FIXA	87.622.942,08	100,29%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	87.366.173,13	99,71%	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	87.366.173,13	99,71%	66,00	215,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,924%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	4,15%	3,11%	6,03%	12,75%	-	0,20%	0,309%	1,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,64%	3,54%	6,53%	12,81%	33,04%	0,20%	0,465%	1,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,66%	3,54%	6,53%	12,72%	32,84%	0,20%	0,481%	1,83%
IRF-M 1	0,874%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
CDI	0,785%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,73%	3,57%	2,53%	5,67%	12,53%	27,03%	0,80%	0,014%	0,05%
IMA-B 5	0,710%	4,83%	3,63%	6,72%	13,17%	33,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	4,77%	3,59%	6,62%	12,96%	32,50%	0,20%	0,516%	2,06%
IRF-M	0,535%	6,48%	4,10%	8,79%	17,62%	36,41%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	6,42%	4,03%	8,65%	17,43%	35,83%	0,20%	1,156%	3,09%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	6,38%	3,98%	8,60%	17,47%	35,61%	0,20%	1,154%	3,10%
IMA Geral	0,287%	5,68%	3,80%	7,66%	15,83%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	5,60%	3,78%	7,66%	15,85%	33,40%	0,20%	0,997%	2,96%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,140%	1,10%	0,72%	1,59%	4,08%	13,74%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	4,98%	3,81%	6,79%	13,34%	13,71%	0,20%	0,622%	2,29%
IMA-B 5+	-0,816%	7,46%	5,11%	9,18%	18,67%	39,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,82%	7,27%	4,99%	8,96%	18,27%	38,38%	0,20%	2,560%	7,99%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,83%	7,26%	4,98%	8,87%	18,35%	38,65%	0,20%	2,592%	7,97%
IMA-B	-0,322%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,79%	1,28%	0,27%	3,05%	5,78%	17,44%	0,20%	0,314%	4,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	6,47%	4,54%	8,25%	16,41%	34,52%	0,20%	1,894%	5,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,34%	6,47%	4,54%	8,17%	16,36%	35,97%	0,20%	1,900%	5,85%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	47.614.106,15	54,34%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	40.008.835,93	45,66%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5+	27.296.910,04	31,15%
IMA-B	23.374.977,56	26,68%
IDKA IPCA 2A	18.966.353,71	21,65%
IRF-M	7.850.260,81	8,96%
IMA-B 5	7.383.553,90	8,43%
IPCA	2.113.807,81	2,41%
CDI	256.768,95	0,29%
IRF-M 1	218.007,17	0,25%
IMA-GERAL	162.302,13	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%
Fevereiro	83.039.727,09	26.094.947,59	25.631.156,13	85.660.017,26	2.156.498,71	2,58%	0,75%	345,05%	1,58%
Março	85.660.017,26	1.296.933,66	772.248,09	87.159.623,33	974.920,50	1,13%	0,78%	144,18%	1,73%
Abril	87.159.623,33	2.308.994,59	1.798.542,48	87.622.942,08	-47.133,36	-0,05%	0,56%	-9,64%	1,57%
Acumulado no ano					4.278.129,38	5,19%	3,02%	172,03%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	44.941,57	0,00	0,00	45.329,15	387,58	0,86%	0,16%	0,86%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	171.212,19	0,00	0,00	172.678,02	1.465,83	0,86%	0,16%	0,86%	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	565.288,20	0,00	0,00	569.753,88	4.465,68	0,79%	0,31%	0,79%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	577.573,77	0,00	0,00	582.127,36	4.553,59	0,79%	0,31%	0,79%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.221.921,95	0,00	0,00	8.286.616,14	64.694,19	0,79%	0,46%	0,79%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.021.204,70	0,00	0,00	10.097.610,21	76.405,51	0,76%	0,48%	0,76%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.615,38	0,00	0,00	1.627,15	11,77	0,73%	0,01%	0,73%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.766.676,75	0,00	0,00	6.813.800,02	47.123,27	0,70%	0,52%	0,70%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.099.940,21	0,00	0,00	2.113.807,81	13.867,60	0,66%	0,62%	0,66%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	433.245,73	0,00	0,00	435.418,03	2.172,30	0,50%	1,16%	0,50%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.379.919,91	0,00	0,00	7.414.842,78	34.922,87	0,47%	1,15%	0,47%	
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	161.793,86	0,00	0,00	162.302,13	508,27	0,31%	1,00%	0,31%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	738.986,81	1.308.994,59	1.798.542,48	255.141,80	5.702,88	0,28%	0,01%	0,73%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.480.980,45	0,00	0,00	9.448.642,25	-32.338,20	-0,34%	1,89%	-0,34%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.974.464,09	0,00	0,00	13.926.335,31	-48.128,78	-0,34%	1,90%	-0,34%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.525.984,13	1.000.000,00	0,00	12.425.717,39	-100.266,74	-0,80%	2,59%	-0,83%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.993.873,63	0,00	0,00	14.871.192,65	-122.680,98	-0,82%	2,56%	-0,82%	
Total Renda Fixa						-47.133,36	-0,05%	1,57%	