

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.674.745,47	7,79%	712	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.869.608,88	17,36%	248	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	11.430.962,36	13,34%	282	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	426.948,56	0,50%	643	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	169.347,75	0,20%	1.177	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.106.864,03	9,46%	611	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.833.506,64	16,15%	624	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.882.047,53	11,54%	722	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.068.619,17	2,41%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.276.134,93	8,49%	233	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	159.893,78	0,19%	203	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	570.045,31	0,67%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	44.446,32	0,05%	1.341	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.383.898,40	10,95%	746	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	557.882,02	0,65%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	203.466,30	0,24%	599	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.599,81	0,00%	196	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
Total			85.660.017,26				

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%	85.454.951,15	99,76%	30,00%	35,00%	70,00%	-25.492.939,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	51.396.010,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	25.698.005,18
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.849.002,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.283.000,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.283.000,86
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.849.002,59
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.283.000,86
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.283.000,86
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.283.000,86
Total Carteira		85.454.951,15					

RENTA FIXA	85.660.017,26	100,24%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	85.454.951,15	99,76%	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	85.454.951,15	99,76%	66,00	215,00

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 5+	5,058%	7,41%	11,40%	11,75%	35,35%	43,21%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,99%	7,26%	11,25%	11,47%	35,16%	42,32%	0,20%	2,464%	10,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,97%	7,26%	11,23%	11,54%	34,89%	41,79%	0,20%	2,447%	10,42%

IMA-B	3,849%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,85%	5,76%	8,82%	9,81%	26,50%	37,94%	0,20%	1,855%	7,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,83%	5,74%	8,78%	9,92%	26,54%	36,41%	0,20%	1,859%	7,37%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,82%	-0,83%	0,28%	2,67%	6,01%	-	0,20%	5,124%	4,62%

IMA Geral	2,265%	4,11%	6,07%	8,66%	21,43%	34,20%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,24%	4,03%	6,02%	8,81%	21,40%	33,51%	0,20%	0,910%	3,63%

IRF-M	2,013%	4,34%	6,27%	10,02%	23,33%	35,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,04%	4,39%	6,28%	10,04%	23,40%	34,44%	0,20%	0,949%	3,53%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	4,35%	6,23%	9,96%	23,21%	34,54%	0,20%	0,949%	3,52%

IMA-B 5	1,492%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%

IDKA IPCA 2 Anos	1,351%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	2,42%	3,70%	6,10%	12,74%	31,60%	0,20%	0,609%	2,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	2,37%	3,63%	6,06%	12,84%	31,83%	0,20%	0,596%	2,15%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	1,99%	3,13%	5,65%	12,31%	-	0,20%	0,424%	1,21%
IRF-M 1	1,007%	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	0,864%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,81%	1,83%	2,90%	6,01%	12,94%	27,21%	0,80%	0,005%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,80%	1,83%	2,90%	6,03%	13,03%	27,35%	1,00%	0,007%	0,08%
IPCA	0,330%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,59%	2,74%	4,19%	6,44%	13,77%	-	0,20%	0,854%	2,56%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	47.075.073,64	54,96%
BB Gestão de Recursos DTVM	38.584.943,62	45,04%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5+	26.300.571,24	30,70%
IMA-B	23.217.405,04	27,10%
IDKA IPCA 2A	18.558.956,87	21,67%
IRF-M	7.703.083,49	8,99%
IMA-B 5	7.232.627,49	8,44%
IPCA	2.068.619,17	2,41%
IRF-M 1	213.794,07	0,25%
CDI	205.066,11	0,24%
IMA-GERAL	159.893,78	0,19%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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%
Acumulado no ano					3.350.342,24	4,07%	1,65%	246,96%	

Acumulado no Ano

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.321.112,41	0,00	0,00	13.833.506,64	512.394,23	3,85%	1,85%	3,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.838.806,76	11.513.829,98	0,00	14.869.608,88	516.972,14	3,60%	2,45%	4,97%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.087.820,78	2.000.000,00	0,00	9.383.898,40	296.077,62	3,26%	1,86%	3,83%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	156.394,00	0,00	0,00	159.893,78	3.499,78	2,24%	0,91%	2,24%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.130.890,53	0,00	0,00	7.276.134,93	145.244,40	2,04%	0,95%	2,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	418.553,96	0,00	0,00	426.948,56	8.394,60	2,01%	0,95%	2,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	11.250.000,00	0,00	11.430.962,36	180.962,36	1,61%	2,46%	4,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.095.403,46	0,00	59.848,78	2.068.619,17	33.064,49	1,58%	0,85%	1,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.577.552,78	0,00	0,00	6.674.745,47	97.192,69	1,48%	0,72%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.817.170,08	0,00	4.100.000,00	9.882.047,53	164.877,45	1,19%	0,61%	1,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.186.634,35	0,00	2.186.000,00	8.106.864,03	106.229,68	1,04%	0,60%	1,29%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	568.235,96	0,00	15.829,98	557.882,02	5.476,04	0,96%	5,12%	-1,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	580.911,09	0,00	16.435,65	570.045,31	5.569,87	0,96%	0,42%	0,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.801.986,59	0,00	5.660.000,00	169.347,75	27.361,16	0,47%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.328.795,76	0,00	10.328.000,00	44.446,32	43.650,56	0,42%	0,08%	0,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.144.767,63	1.315.287,23	2.265.211,74	203.466,30	8.623,18	0,35%	0,01%	0,80%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	984.690,95	15.830,38	999.829,98	1.599,81	908,46	0,09%	0,00%	0,81%
Total Renda Fixa					2.156.498,71	2,58%	1,58%	