

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.759.609,82	15,67%	612	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	174.209,57	0,20%	1.184	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.437.193,26	8,47%	287	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.335.938,50	10,63%	744	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.306.181,71	16,29%	291	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	40.299,41	0,05%	1.348	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	12.849.449,94	14,63%	314	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	162.425,67	0,18%	206	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.137.195,95	11,54%	716	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.819.571,58	7,77%	716	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	586.255,95	0,67%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.119.258,69	2,41%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	573.794,71	0,65%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	436.501,82	0,50%	677	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.320.870,87	9,47%	609	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	852,37	0,00%	199	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	764.690,20	0,87%	611	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV
		Total	87.824.300,02				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	87.058.757,45	99,13%	30,00%	35,00%	70,00%	-25.581.747,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	52.694.580,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	26.347.290,01
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.173.645,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.391.215,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.391.215,00
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.173.645,00
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.391.215,00
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.391.215,00
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.391.215,00
Total Carteira		87.058.757,45					

RENDA FIXA	87.824.300,02	100,88%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	87.058.757,45	99,13%	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	87.058.757,45	99,13%	66,00	215,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,352%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,30%	6,70%	2,21%	8,63%	17,42%	33,87%	0,20%	6,417%	4,88%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,25%	6,68%	2,24%	8,61%	17,38%	34,04%	0,20%	6,393%	4,86%
IRF-M 1	0,886%	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%
IMA Geral	0,817%	6,55%	1,12%	6,55%	14,23%	32,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	5,68%	1,58%	7,70%	15,49%	31,07%	0,20%	6,387%	4,77%
CDI	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,85%	4,45%	2,58%	5,55%	12,32%	26,95%	0,80%	0,000%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	4,42%	2,54%	5,52%	12,44%	27,01%	1,00%	0,007%	0,10%
IDKA IPCA 2 Anos	0,793%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,89%	2,84%	6,06%	12,05%	29,85%	0,20%	2,337%	1,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	5,07%	2,64%	6,36%	12,38%	31,14%	0,20%	3,767%	2,85%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,07%	2,58%	6,38%	12,32%	30,95%	0,20%	3,873%	2,93%
IMA-B 5	0,525%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	4,86%	2,17%	6,30%	12,18%	30,41%	0,20%	4,893%	3,58%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	0,164%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	1,99%	2,85%	3,14%	5,79%	15,73%	0,20%	2,370%	4,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,19%	5,20%	-0,51%	8,22%	15,18%	29,64%	0,20%	13,312%	9,77%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,20%	5,20%	-0,53%	8,24%	15,11%	30,93%	0,20%	13,324%	9,79%
IPCA	-0,230%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	5,25%	2,45%	6,74%	12,55%	29,97%	0,20%	4,542%	3,56%
IMA-B 5+	-0,055%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,67%	5,47%	-1,66%	9,38%	17,23%	31,89%	0,20%	16,974%	12,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,94%	5,18%	-1,95%	9,08%	16,86%	31,74%	0,20%	17,162%	12,79%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	46.997.128,08	53,51%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	40.827.171,94	46,49%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5+	27.155.631,65	30,92%
IMA-B	23.095.548,32	26,30%
IDKA IPCA 2A	19.044.322,77	21,68%
IRF-M	7.873.695,08	8,97%
IMA-B 5	7.393.366,29	8,42%
IPCA	2.119.258,69	2,41%
CDI	765.542,57	0,87%
IRF-M 1	214.508,98	0,24%
IMA-GERAL	162.425,67	0,18%

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%
Mai	87.622.942,08	45.902.418,89	44.735.839,92	87.824.300,02	-965.221,03	-1,09%	0,82%	-132,32%	10,69%
Acumulado no ano					3.312.908,35	4,04%	3,86%	104,73%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	172.678,02	0,00	0,00	174.209,57	1.531,55	0,89%	0,96%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	582.127,36	0,00	0,00	586.255,95	4.128,59	0,71%	2,34%	0,71%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	569.753,88	0,00	0,00	573.794,71	4.040,83	0,71%	2,37%	0,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.286.616,14	0,00	0,00	8.320.870,87	34.254,73	0,41%	3,77%	0,41%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.097.610,21	0,00	0,00	10.137.195,95	39.585,74	0,39%	3,87%	0,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	255.141,80	2.350.152,73	1.849.499,25	764.690,20	8.894,92	0,34%	0,01%	0,82%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.414.842,78	0,00	0,00	7.437.193,26	22.350,48	0,30%	6,42%	0,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.113.807,81	0,00	0,00	2.119.258,69	5.450,88	0,26%	4,54%	0,26%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	435.418,03	0,00	0,00	436.501,82	1.083,79	0,25%	6,39%	0,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	45.329,15	14.800.000,00	14.840.657,17	40.299,41	35.627,43	0,24%	0,96%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.813.800,02	0,00	0,00	6.819.571,58	5.771,56	0,08%	4,89%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	162.302,13	0,00	0,00	162.425,67	123,54	0,08%	6,39%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.627,15	2.200.001,19	2.201.635,32	852,37	859,35	0,04%	0,00%	0,85%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.425.717,39	12.552.264,97	11.886.340,67	12.849.449,94	-242.191,75	-0,97%	17,16%	-1,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.448.642,25	0,00	0,00	9.335.938,50	-112.703,75	-1,19%	13,31%	-1,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.926.335,31	0,00	0,00	13.759.609,82	-166.725,49	-1,20%	13,32%	-1,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.871.192,65	14.000.000,00	13.957.707,51	14.306.181,71	-607.303,43	-2,10%	16,97%	-1,67%
Total Renda Fixa					-965.221,03	-1,09%	10,69%	