

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



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%	102.169.372,95	79,92%	50,00%	0,00%	100,00%	25.675.380,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	2.747.487,18	2,15%	0,00%	0,00%	80,00%	99.528.315,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	1.939.488,00	1,52%	0,00%	0,00%	2,00%	617.407,08
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	2.951.185,03	2,31%	0,00%	0,00%	10,00%	9.833.290,35
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.538.751,37	1,20%	0,00%	0,00%	5,00%	4.853.486,32
Desenquadrado - RV	0,00%	946.071,71	0,74%	0,00%	0,00%	0,00%	-946.071,71
DF - Artigo 6º	100,00%	3.367.686,97	2,63%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.367.686,97
Total Carteira		115.660.043,21					

RENDA FIXA	125.776.432,63	108,75%
RENDA VARIÁVEL	5.436.008,11	4,70%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 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 '	102.169.372,95	77,87%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.747.487,18	2,09%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	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%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	1.939.488,00	1,48%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.951.185,03	2,25%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.538.751,37	1,17%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	946.071,71	0,72%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	3.367.686,97	2,57%	0,00%	0,00%
Total	115.660.043,21	88,15%	50,00	479,00

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	3,849%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,59%	2,74%	4,19%	6,44%	13,77%	-	0,20%	0,854%	2,56%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,98%	0,23%	1,79%	3,85%	8,25%	-	0,20%	5,730%	6,17%
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-B 5	1,492%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,60%	3,98%	5,81%	7,55%	19,73%	33,78%	0,20%	1,732%	6,27%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FIC RENDA FIXA LP	1,50%	2,65%	4,02%	6,19%	12,97%	31,06%	0,50%	0,748%	2,41%
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%
IRF-M 1	1,007%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
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%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,90%	2,02%	3,19%	6,59%	13,40%	28,83%	0,20%	0,015%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	2,00%	3,16%	6,52%	13,85%	29,49%	0,20%	0,015%	0,17%
SANTANDER PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,97%	3,12%	6,47%	13,96%	29,54%	0,20%	0,006%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,81%	1,83%	2,90%	6,01%	12,94%	27,21%	0,80%	0,005%	0,02%

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 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 + 6,00% ao ano	0,748%	1,65%	2,47%	4,47%	11,04%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94%	1,88%	3,12%	5,03%	13,46%	-	0,20%	0,441%	1,88%
IPCA	0,330%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	4,13%	5,96%	7,60%	21,08%	34,12%	0,15%	1,773%	6,59%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,00%	16,18%	15,16%	29,01%	90,61%	38,26%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5,13%	12,85%	13,30%	9,05%	35,11%	21,93%	2,00%	6,468%	19,37%
Ibovespa	3,08%	10,68%	7,68%	15,13%	55,78%	29,23%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3,60%	10,67%	9,10%	11,53%	42,53%	23,81%	1,00%	6,755%	20,77%
XP INVESTOR FI AÇÕES	3,19%	11,66%	11,19%	12,64%	60,90%	56,31%	2,00%	5,342%	19,94%
IPCA + 9,00% ao ano	0,95%	2,10%	3,18%	5,90%	14,19%	37,26%	-	-	-
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	100.797.765,34	76,82%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.137.246,41	16,11%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.367.686,97	2,57%
BEM DTVM	2.747.487,18	2,09%
LAD CAPITAL	1.538.751,37	1,17%
SANTANDER CACEIS	1.022.838,74	0,78%
BANCO SANTANDER	600.664,73	0,46%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	53.170.732,35	40,52%
IMA-B 5	50.622.653,80	38,58%
CDI	9.071.712,44	6,91%
IRF-M 1	7.604.159,07	5,80%
DISP. FINANCEIRA	3.367.686,97	2,57%
CRÉDITO PRIVADO	1.939.488,00	1,48%
AÇÕES - INDEXADO	1.928.346,29	1,47%
FIP	1.538.751,37	1,17%
AÇÕES - LIVRES	1.022.838,74	0,78%
AÇÕES - DIVIDENDOS	946.071,71	0,72%

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	118.553.590,98	8.125.317,63	3.782.648,15	124.479.573,69	1.583.313,23	1,29%	0,89%	144,44%	1,60%
Fevereiro	124.479.573,69	7.915.075,51	6.594.869,67	127.844.753,77	2.044.974,24	1,63%	0,75%	217,19%	1,34%
Acumulado no ano					3.628.287,47	2,93%	1,65%	178,19%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.310.554,56	0,00	0,00	6.480.685,09	170.130,53	2,70%	1,77%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.946.020,36	0,00	628.801,53	22.909.111,82	591.892,99	2,58%	1,73%	2,60%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.292.038,00	0,00	65.621,86	2.269.612,00	43.195,86	1,88%	5,73%	-0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.185.263,25	0,00	262.348,89	9.067.853,52	144.939,16	1,58%	0,85%	1,59%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FIC RENDA FIXA LP	2.706.963,52	0,00	0,00	2.747.487,18	40.523,66	1,50%	0,75%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.855.151,46	1.944.000,00	0,00	44.362.862,48	563.711,02	1,29%	0,61%	1,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.428.979,21	268.444,60	0,00	8.807.869,87	110.446,06	1,27%	0,60%	1,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.529.843,75	0,00	0,00	7.604.159,07	74.315,32	0,99%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.280.564,87	0,00	202.822,74	7.147.904,19	70.162,06	0,96%	5,12%	-1,82%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.921.399,50	0,00	0,00	1.939.488,00	18.088,50	0,94%	0,44%	0,94%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	854.200,90	0,00	0,00	861.901,74	7.700,84	0,90%	0,01%	0,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	719.832,78	0,00	0,00	726.250,82	6.418,04	0,89%	0,02%	0,89%
SANTANDER PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	595.509,05	0,00	0,00	600.664,73	5.155,68	0,87%	0,01%	0,87%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	964.473,84	268.410,10	268.410,10	972.372,35	7.898,51	0,64%	0,00%	0,81%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.597.519,85	5.434.220,81	5.166.864,55	5.910.522,80	45.646,69	0,41%	0,01%	0,80%
				Total Renda Fixa	1.900.224,92	1,58%	1,18%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	899.889,96	0,00	0,00	946.071,71	46.181,75	5,13%	6,47%	5,13%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.861.286,05	0,00	0,00	1.928.346,29	67.060,24	3,60%	6,76%	3,60%
XP INVESTOR FI AÇÕES	991.180,65	0,00	0,00	1.022.838,74	31.658,09	3,19%	5,34%	3,19%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	1.538.902,13	0,00	0,00	1.538.751,37	-150,76	-0,01%	-	-
Total Renda Variável					144.749,32	2,74%	6,31%	