

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



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 (dezembro / 2016)

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	1.408.665,60	26,74%	598	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	322.916,34	6,13%	193	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.413.886,69	26,84%	1.183	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.059.917,48	39,11%	143	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV
Total para cálculo dos limites da Resolução			5.205.386,11				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			62.123,69	Artigo 6º			
Total			5.267.509,80				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	100,00%	0,00	0,00%	5.205.386,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	3.145.468,63	60,43%	2.059.917,48
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	780.807,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	80,00%	0,00	0,00%	4.164.308,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	80,00%	80,00%	0,00	0,00%	4.164.308,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	1.561.615,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	1.561.615,83
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	1.041.077,22
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	1.041.077,22
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	780.807,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	260.269,31
Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	1.561.615,83
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	1.041.077,22
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	780.807,92
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	260.269,31
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	260.269,31
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	260.269,31
Total	30,00%	80,00	0,00	0,00%	

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,842%	23,37%	3,41%	7,88%	23,37%	32,16%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,81%	23,21%	3,35%	7,81%	23,21%	31,53%	0,20%	1,844%	3,61%
IDKA IPCA 2 Anos	1,283%	15,21%	2,28%	6,11%	15,21%	34,09%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	13,26%	2,23%	5,49%	13,26%	-	0,20%	0,771%	1,21%
IRF-M 1	1,196%	14,72%	3,22%	6,79%	14,72%	29,64%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	14,48%	3,16%	6,66%	14,48%	28,89%	0,10%	0,100%	0,35%
IPCA	0,300%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	13,44%	2,12%	5,08%	13,44%	33,36%	0,20%	0,191%	0,37%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	2.059.917,48	39,57%
IRF-M 1	1.413.886,69	27,16%
IRF-M	1.408.665,60	27,06%
IDKA IPCA 2A	322.916,34	6,20%
DISP. FINANCEIRA	62.123,69	1,19%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.383.658,87	0,00	0,00	1.408.665,60	25.006,73	1,81%	1,84%	1,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	319.331,91	0,00	0,00	322.916,34	3.584,43	1,12%	0,77%	1,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.616.057,49	1.000,00	1.230.735,26	1.413.886,69	27.564,46	1,05%	0,10%	1,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.044.702,46	0,00	0,00	2.059.917,48	15.215,02	0,74%	0,19%	0,74%
Total Renda Fixa					71.370,64	1,12%	0,65%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.565.481,96	1.000,00	1.230.735,26	1.413.886,69	78.139,99	3,05%	3,16%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.362.968,05	0,00	0,00	1.408.665,60	45.697,55	3,35%	3,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.017.062,61	0,00	0,00	2.059.917,48	42.854,87	2,12%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	315.882,01	0,00	0,00	322.916,34	7.034,33	2,23%	2,23%
Total Renda Fixa					173.726,74	2,77%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.321.773,69	3.229.902,99	5.547.057,01	1.413.886,69	409.267,02	11,95%	14,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.925.376,06	0,00	115.978,30	2.059.917,48	250.519,72	13,40%	13,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.087.912,56	0,00	1.968.489,59	322.916,34	203.493,37	13,32%	13,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.522.524,02	0,00	1.600.386,59	0,00	77.862,57	5,11%	14,89%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04	1.335.534,69	0,00	1.408.665,60	73.130,87	5,48%	23,21%
Total Renda Fixa					1.014.273,55	13,47%	

