Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017

riskoffice

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 (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.031.676,67	1,11%	1.181	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	857.842,17	0,47%	73	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.760.837,83	4,80%	728	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.424.841,40	4,07%	1.347	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	50.419.097,15	27,62%	714	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	27.493.727,34	15,06%	616	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	230.357,10	0,13%	54	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.630.268,57	4,18%	619	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.566.805,37	16,19%	730	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	827.725,03	0,45%	193	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	571.174,85	0,31%	14	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1801	Não há	3.118.139,88	1,71%	14	3,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.156.321,85	1,73%	84	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.860.028,79	8,14%	327	0,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	19.972.177,50	10,94%	770	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	698.602,79	0,38%	786	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PRASS II FIDC SÊNIOR	D+540	Não há	1.420.917,07	0,78%	20	1,13%	Artigo 7º, Inciso VI
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	8.101,31	0,00%	42	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	98.724,74	0,05%	1	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.138.729,76	0,62%	33	0,44%	Artigo 8º, Inciso IV
ÁTICO FLORESTAL - FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.260.909,90	0,69%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso V
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.029.990,00	0,56%		0,63%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	**182.576.997,07**				

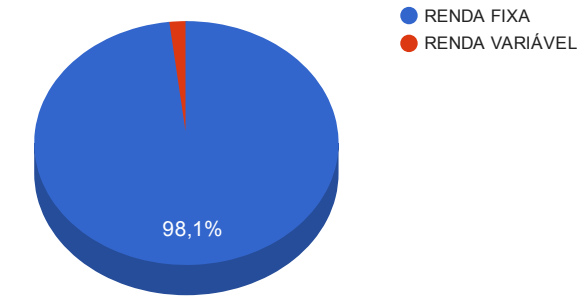
Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

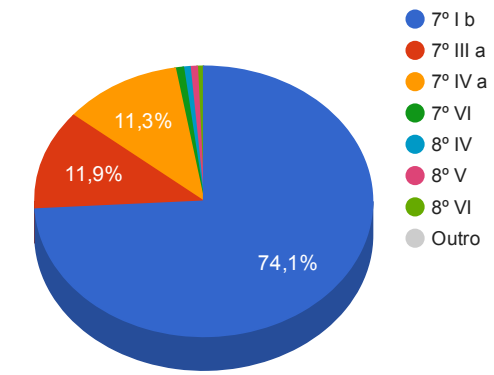
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	135.243.178,63	74,07%	0,00%	90,00%	0,00%	-135.243.178,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	21.705.665,37	11,89%	0,00%	20,00%	0,00%	-21.705.665,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	20.670.780,29	11,32%	0,00%	30,00%	0,00%	-20.670.780,29
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.420.917,07	0,78%	0,00%	5,00%	0,00%	-1.420.917,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	106.826,05	0,06%	0,00%	3,00%	0,00%	-106.826,05
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
Total Renda Fixa	100,00%	179.147.367,41	98,12%	0,00	165,00	0,00	-

Artigos - Renda Fixa Artigos - Renda Variável	Resolução % Resolução %	Carteira $ Carteira $	Carteira % Carteira %	Estratégia de Alocação Estratégia de Alocação			GAP Superior GAP Superior
				Inferior % Inferior %	Alvo % Alvo %	Superior % Superior %	
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.138.729,76	0,62%	0,00%	5,00%	0,00%	-1.138.729,76
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.260.909,90	0,69%	0,00%	5,00%	0,00%	-1.260.909,90
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.029.990,00	0,56%	0,00%	5,00%	0,00%	-1.029.990,00
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00
Total Renda Variável	30,00%	3.429.629,66	1,88%	0,00	45,00	0,00	-

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	135.243.178,63	74,07%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	21.705.665,37	11,89%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	20.670.780,29	11,32%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.420.917,07	0,78%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	106.826,05	0,06%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	179.147.367,41	98,12%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso IV	1.138.729,76	0,62%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.260.909,90	0,69%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.029.990,00	0,56%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	3.429.629,66	1,88%	0,00	0,00

Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	2,28%	2,28%	4,50%	8,90%	22,76%	32,81%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	2,29%	4,44%	8,85%	22,68%	32,25%	0,20%	1,492%	3,59%
IMA-B	1,87%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,89%	1,89%	3,54%	7,01%	24,43%	33,34%	0,20%	3,190%	7,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,84%	1,84%	3,55%	6,75%	24,64%	32,05%	0,20%	3,342%	7,48%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,31%	1,31%	3,18%	6,79%	14,38%	29,53%	1,30%	2,136%	19,39%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	0,90%	0,90%	4,46%	5,98%	21,32%	25,13%	1,30%	1,231%	16,42%
CDI + 3,50% ao ano	1,39%	1,39%	4,18%	8,68%	18,04%	38,46%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,69%	-0,69%	-8,48%	-72,17%	-73,35%	-64,98%	0,39%	2,178%	69,19%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-56,04%	-56,04%	-18,71%	-28,32%	-37,21%	-68,51%	0,20%	3,401%	119,46%
IRF-M 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	14,07%	29,23%	0,10%	0,297%	0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	13,96%	29,19%	0,20%	0,294%	0,32%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,25%	1,25%	3,49%	6,95%	14,13%	29,50%	0,20%	0,296%	0,32%
IMA-B 5	1,16%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%

Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,12%	1,12%	2,88%	5,85%	13,00%	31,06%	0,40%	1,254%	2,48%
IDKA IPCA 2 Anos	1,09%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,08%	2,89%	6,06%	12,74%	31,45%	0,20%	1,089%	2,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	2,89%	5,98%	12,92%	31,70%	0,20%	1,042%	2,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	1,01%	2,84%	5,36%	12,37%	-	0,20%	0,835%	1,23%
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	1,10%	3,32%	6,91%	13,93%	29,41%	0,20%	0,020%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	1,07%	3,27%	6,77%	14,03%	29,36%	0,20%	0,035%	0,05%
IPCA + 7,00% ao ano	0,97%	0,97%	2,61%	5,20%	12,76%	33,46%	-	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	1,46%	1,46%	3,36%	6,28%	14,34%	35,21%	1,70%	0,013%	-

Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

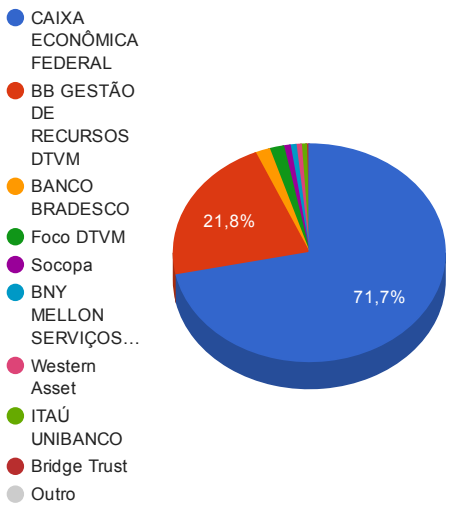
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	3,76%	3,76%	2,60%	11,47%	46,29%	40,96%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,98%	0,98%	-1,88%	6,30%	43,05%	25,61%	1,20%	-	-
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,89%	1,89%	4,39%	9,47%	17,07%	40,38%	2,00%	0,711%	1,85%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL - FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,001%	0,02%

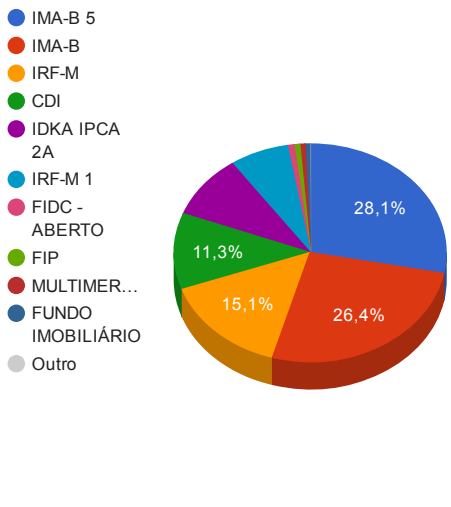
Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	130.903.208,78	71,70%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	39.812.569,66	21,81%
BANCO BRADESCO	3.156.321,85	1,73%
Foco DTVM	3.118.139,88	1,71%
Socopa	1.420.917,07	0,78%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.260.909,90	0,69%
Western Asset	1.138.729,76	0,62%
ITAÚ UNIBANCO	1.088.199,27	0,60%
Bridge Trust	571.174,85	0,31%
BRL Trust Investimentos	98.724,74	0,05%
CITIBANK DTVM	8.101,31	0,00%



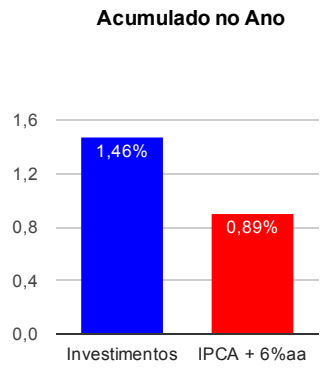
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	51.276.939,32	28,09%
IMA-B	48.116.148,89	26,35%
IRF-M	27.493.727,34	15,06%
CDI	20.670.780,29	11,32%
IDKA IPCA 2A	17.218.831,43	9,43%
IRF-M 1	12.843.197,02	7,03%
FIDC - ABERTO	1.420.917,07	0,78%
FIP	1.260.909,90	0,69%
MULTIMERCADO	1.138.729,76	0,62%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.029.990,00	0,56%
FIDC - FECHADO	106.826,05	0,06%

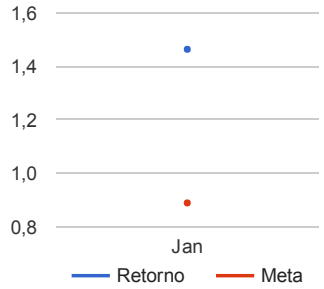


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno ($)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	176.426.263,36	3.845.430,28	329.839,39	182.576.997,07	2.635.142,82	1,46%	0,89%	164,19%	1,54%
Acumulado no ano					2.635.142,82	1,46%	0,89%	164,19%	





Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

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	26.877.056,00	0,00	0,00	27.493.727,34	616.671,34	2,29%	1,49%	2,29%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	14.584.646,51	0,00	0,00	14.860.028,79	275.382,28	1,89%	3,19%	1,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.031.871,14	0,00	0,00	29.566.805,37	534.934,23	1,84%	3,34%	1,84%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.400.523,35	0,00	0,00	1.420.917,07	20.393,72	1,46%	0,01%	1,46%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	563.197,29	0,00	0,00	571.174,85	7.977,56	1,42%	2,14%	1,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.006.396,04	0,00	0,00	2.031.676,67	25.280,63	1,26%	0,30%	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.332.545,23	0,00	0,00	7.424.841,40	92.296,17	1,26%	0,29%	1,26%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	227.499,98	0,00	0,00	230.357,10	2.857,12	1,26%	0,29%	1,26%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.117.324,26	0,00	0,00	3.156.321,85	38.997,59	1,25%	0,30%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	49.851.995,35	0,00	0,00	50.419.097,15	567.101,80	1,14%	1,25%	1,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	848.328,43	0,00	0,00	857.842,17	9.513,74	1,12%	1,25%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	691.016,43	0,00	0,00	698.602,79	7.586,36	1,10%	0,02%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.666.958,35	0,00	0,00	8.760.837,83	93.879,48	1,08%	1,09%	1,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.549.948,68	0,00	0,00	7.630.268,57	80.319,89	1,06%	1,04%	1,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	819.484,01	0,00	0,00	827.725,03	8.241,02	1,01%	0,84%	1,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.248.898,60	3.845.430,28	310.318,35	19.972.177,50	188.166,97	0,94%	0,03%	1,07%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	3.090.450,01	0,00	0,00	3.118.139,88	27.689,87	0,90%	1,23%	0,90%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	99.411,02	0,00	924,90	98.724,74	238,62	0,24%	2,18%	0,24%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	18.429,42	0,00	10.199,86	8.101,31	-128,25	-0,70%	3,40%	-1,72%
			Total Renda Fixa		2.597.400,14	1,47%	1,56%	

Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.117.631,18	0,00	0,00	1.138.729,76	21.098,58	1,89%	0,71%	1,89%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.020.000,00	0,00	8.396,28	1.029.990,00	18.386,28	1,80%	-	0,98%
ÁTICO FLORESTAL - FIP	1.262.652,08	0,00	0,00	1.260.909,90	-1.742,18	-0,14%	0,00%	-0,14%
			Total Renda Variável		37.742,68	1,11%	0,34%	

Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000