

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 (abril / 2016)

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	7.235.134,65	10,24%	545	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.400.679,48	7,64%	1.174	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.584.386,12	7,90%	199	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.327.901,53	7,54%	625	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.312.047,49	8,93%	105	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	370.801,48	0,52%	513	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	67.540,43	0,10%	129	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.114.778,00	2,99%	85	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	3.780.030,81	5,35%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.322.364,36	8,95%	567	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.357.686,27	14,66%	723	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.508.813,79	16,28%	1.326	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.861.471,22	5,46%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	287.595,48	0,41%	577	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	171.845,77	0,24%	143	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	14/06/2016	1.969.687,00	2,79%	23	1,69%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
<b>Total</b>			<b>70.672.763,88</b>				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	68.243.635,63	96,56%	2.429.128,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	35.336.381,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	21.201.829,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.067.276,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	1.969.687,00	2,79%	1.563.951,19
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>70.213.322,63</b>	<b>99,35%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.067.276,39
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	10.600.914,58
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.533.638,19
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.533.638,19
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.533.638,19
<b>Total</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,368%	18,66%	17,25%	21,62%	17,80%	38,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,29%	18,41%	17,16%	21,03%	17,01%	37,15%	0,20%	5,468%	13,77%
IMA-B	3,926%	14,06%	11,92%	16,99%	17,27%	35,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,93%	13,93%	11,93%	16,76%	15,56%	33,21%	0,20%	3,879%	9,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,90%	13,93%	11,89%	16,80%	16,85%	34,63%	0,20%	3,855%	9,80%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	1,31%	-0,26%	3,98%	-	-	0,20%	0,245%	-
IRF-M	3,460%	11,68%	8,65%	13,35%	15,97%	28,22%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,53%	11,62%	8,77%	13,30%	15,44%	27,40%	0,20%	2,049%	4,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,51%	11,66%	8,69%	13,29%	15,67%	27,64%	0,20%	2,050%	4,38%
IMA Geral	2,894%	10,39%	8,21%	12,68%	15,71%	30,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,93%	10,25%	8,12%	12,52%	15,15%	29,26%	0,20%	2,027%	4,86%
IDKA IPCA 2 Anos	1,656%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,66%	6,67%	3,55%	9,28%	17,85%	31,37%	0,20%	1,232%	3,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	6,62%	3,65%	9,26%	17,94%	31,77%	0,20%	1,222%	3,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	4,61%	2,76%	7,35%	-	-	0,20%	0,353%	-
IPCA + 6,00% ao ano	1,076%	5,20%	3,40%	8,33%	15,78%	32,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94%	4,97%	3,59%	8,05%	15,06%	31,99%	0,20%	0,059%	0,37%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,066%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,15%	3,47%	7,48%	14,38%	26,61%	0,10%	0,179%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	5,15%	3,47%	7,49%	14,50%	26,91%	0,20%	0,173%	0,50%
CDI	1,054%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,99%	4,06%	3,04%	6,23%	12,89%	24,76%	0,80%	0,000%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,92%	3,93%	2,92%	6,11%	12,80%	24,72%	1,00%	0,031%	0,04%
IPCA	0,610%	3,25%	1,95%	5,29%	9,28%	18,21%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	6,63%	4,15%	9,63%	0,33%	-	0,20%	1,194%	3,64%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2016)

Administrador	Valor	%
Caixa Econômica Federal	39.379.364,49	55,72%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.293.399,39	44,28%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	20.460.081,44	28,95%
IRF-M 1	16.909.493,27	23,93%
IMA-B	12.563.036,18	17,78%
IRF-M	6.682.848,97	9,46%
IMA-GERAL	5.584.386,12	7,90%
IPCA	3.861.471,22	5,46%
CDI	459.441,25	0,65%
IMA-B 5+	67.540,43	0,10%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

**Acumulado no Ano**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	63.527.792,73	1.020.271,84	460.000,00	65.442.807,02	1.354.742,45	2,11%	1,74%	121,53%	1,23%
Fevereiro	65.442.807,02	1.228.953,35	751.371,74	66.889.690,07	969.301,44	1,47%	1,34%	109,38%	1,44%
Março	66.889.690,07	1.119.524,85	624.503,27	68.788.527,21	1.403.815,56	2,08%	0,94%	221,11%	2,32%
Abril	68.788.527,21	1.090.117,83	656.354,89	70.672.763,88	1.450.473,73	2,10%	1,08%	194,68%	1,47%
Acumulado no ano					5.178.333,18	7,99%	5,20%	153,70%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	64.149,46	0,00	0,00	67.540,43	3.390,97	5,29%	5,47%	5,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.126.337,60	0,00	0,00	5.327.901,53	201.563,93	3,93%	3,88%	3,93%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.963.281,72	0,00	0,00	7.235.134,65	271.852,93	3,90%	3,85%	3,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.097.113,81	0,00	0,00	6.312.047,49	214.933,68	3,53%	2,05%	3,53%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	358.230,72	0,00	0,00	370.801,48	12.570,76	3,51%	2,05%	3,51%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.425.262,35	0,00	0,00	5.584.386,12	159.123,77	2,93%	2,03%	2,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.188.663,28	0,00	0,00	10.357.686,27	169.022,99	1,66%	1,23%	1,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.221.740,46	0,00	0,00	6.322.364,36	100.623,90	1,62%	1,22%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.802.952,93	0,00	0,00	3.861.471,22	58.518,29	1,54%	1,19%	1,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.341.135,33	0,00	0,00	5.400.679,48	59.544,15	1,11%	0,18%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.382.962,93	0,00	0,00	11.508.813,79	125.850,86	1,11%	0,17%	1,11%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.951.379,00	0,00	0,00	1.969.687,00	18.308,00	0,94%	0,06%	0,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.747.140,87	0,00	0,00	3.780.030,81	32.889,94	0,88%	0,35%	0,88%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	100,39	172.741,59	2.500,00	171.845,77	1.503,79	0,87%	0,00%	0,99%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.100.006,00	0,00	0,00	2.114.778,00	14.772,00	0,70%	0,24%	0,70%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	18.070,36	917.376,24	653.854,89	287.595,48	6.003,77	0,64%	0,03%	0,92%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.450.473,73</b>	<b>2,10%</b>	<b>1,47%</b>	