

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

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.320.569,08	7,41%	639	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.009,85	0,01%	136	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	371.855,36	0,52%	521	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	140.639,05	0,20%	198	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.372.642,80	8,88%	579	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.333.915,07	8,82%	106	2,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.629.961,64	16,20%	1.331	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.898.608,99	5,43%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.546.969,94	7,73%	686	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.226.464,02	10,07%	547	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.435.637,34	14,54%	728	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.456.824,72	7,60%	1.176	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	3.830.769,82	5,34%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.145.462,00	2,99%	85	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	358.551,69	0,50%	148	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	712.417,73	0,99%	579	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	14/06/2016	1.994.252,00	2,78%	23	1,69%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
<b>Total</b>			<b>71.779.551,10</b>				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	68.714.329,68	95,73%	3.065.221,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	35.889.775,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	21.533.865,33
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.177.955,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	1.994.252,00	2,78%	1.594.725,56
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>70.708.581,68</b>	<b>98,51%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.177.955,11
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	10.766.932,67
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.588.977,56
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.588.977,56
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.588.977,56
<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 (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,271%	6,54%	3,33%	8,11%	15,85%	33,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,25%	6,28%	3,30%	7,98%	15,35%	32,43%	0,20%	0,197%	-
CDI	1,107%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,07%	5,04%	3,08%	6,18%	12,96%	25,07%	1,00%	0,039%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,04%	5,13%	3,14%	6,28%	13,03%	25,06%	0,80%	0,036%	0,01%
IRF-M 1	1,067%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	6,26%	3,42%	7,49%	14,65%	27,05%	0,20%	0,084%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	6,24%	3,41%	7,47%	14,52%	26,76%	0,10%	0,086%	0,51%
IMA-B 5	0,799%	7,82%	3,13%	10,11%	16,83%	31,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	7,67%	3,07%	9,87%	16,25%	30,33%	0,20%	0,906%	3,51%
IPCA	0,780%	4,05%	1,83%	5,05%	9,32%	18,58%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	7,65%	3,56%	9,87%	15,49%	-	0,20%	0,850%	3,48%
IDKA IPCA 2 Anos	0,628%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	6,02%	3,09%	7,85%	15,89%	-	0,20%	0,200%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,47%	3,06%	9,58%	16,70%	31,05%	0,20%	1,279%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,48%	2,96%	9,61%	16,59%	30,65%	0,20%	1,316%	3,23%
IMA Geral	0,421%	10,85%	6,86%	11,97%	14,11%	27,45%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	10,67%	6,78%	11,82%	13,49%	26,53%	0,20%	1,786%	4,85%
IRF-M	0,261%	11,98%	7,28%	12,61%	14,41%	26,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,35%	12,01%	7,42%	12,60%	14,01%	25,51%	0,20%	1,781%	4,34%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	11,97%	7,31%	12,59%	14,19%	25,71%	0,20%	1,748%	4,46%
IMA-B 5+	-0,732%	17,79%	13,27%	19,12%	13,37%	29,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,80%	17,46%	13,15%	18,59%	12,51%	27,92%	0,20%	5,104%	13,77%
IMA-B	-0,098%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,78%	3,09%	4,49%	-	-	0,20%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,12%	13,80%	9,31%	15,48%	13,74%	29,01%	0,20%	3,492%	9,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,14%	13,77%	9,30%	15,43%	12,56%	27,54%	0,20%	3,488%	9,79%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.846.973,12	55,51%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.932.577,98	44,49%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	20.639.049,96	28,75%
IRF-M 1	17.086.786,36	23,80%
IMA-B	12.547.033,10	17,48%
IRF-M	6.705.770,43	9,34%
IMA-B 5	5.546.969,94	7,73%
IPCA	3.898.608,99	5,43%
CDI	1.070.969,42	1,49%
IMA-GERAL	140.639,05	0,20%
IMA-B 5+	4.009,85	0,01%

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%
Mai	70.672.763,88	6.708.796,89	6.109.370,86	71.779.551,10	507.361,19	0,71%	1,27%	56,03%	1,28%
Acumulado no ano					5.685.694,37	8,76%	6,54%	134,03%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de maio / 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	67.540,43	0,00	65.000,00	4.009,85	1.469,42	2,18%	5,10%	-0,80%	
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.114.778,00	0,00	0,00	2.145.462,00	30.684,00	1,45%	-	1,45%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.780.030,81	0,00	0,00	3.830.769,82	50.739,01	1,34%	0,20%	1,34%	
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.969.687,00	0,00	0,00	1.994.252,00	24.565,00	1,25%	0,20%	1,25%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.508.813,79	0,00	0,00	11.629.961,64	121.147,85	1,05%	0,08%	1,05%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.400.679,48	0,00	0,00	5.456.824,72	56.145,24	1,04%	0,09%	1,04%	
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.584.386,12	0,00	5.500.000,00	140.639,05	56.252,93	1,01%	1,79%	0,38%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.861.471,22	0,00	0,00	3.898.608,99	37.137,77	0,96%	0,85%	0,96%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	171.845,77	186.012,63	2.500,00	358.551,69	3.193,29	0,89%	0,04%	1,04%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.322.364,36	0,00	0,00	6.372.642,80	50.278,44	0,80%	1,28%	0,80%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.357.686,27	0,00	0,00	10.435.637,34	77.951,07	0,75%	1,32%	0,75%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	287.595,48	957.784,26	541.870,86	712.417,73	8.908,85	0,72%	0,04%	1,07%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.312.047,49	0,00	0,00	6.333.915,07	21.867,58	0,35%	1,78%	0,35%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	370.801,48	0,00	0,00	371.855,36	1.053,88	0,28%	1,75%	0,28%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.235.134,65	0,00	0,00	7.226.464,02	-8.670,63	-0,12%	3,49%	-0,12%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.327.901,53	0,00	0,00	5.320.569,08	-7.332,45	-0,14%	3,49%	-0,14%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	5.565.000,00	0,00	5.546.969,94	-18.030,06	-0,32%	0,91%	0,78%	
<b>Total Renda Fixa</b>						<b>507.361,19</b>	<b>0,71%</b>	<b>1,28%</b>	