

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	64.149,46	0,09%	122	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.802.952,93	5,53%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.097.113,81	8,86%	93	3,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.188.663,28	14,81%	721	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.221.740,46	9,04%	564	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.341.135,33	7,76%	1.169	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.963.281,72	10,12%	539	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	358.230,72	0,52%	500	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.100.006,00	3,05%	85	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.126.337,60	7,45%	624	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.425.262,35	7,89%	201	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.382.962,93	16,55%	1.319	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	3.747.140,87	5,45%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	100,39	0,00%	139	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	18.070,36	0,03%	579	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	14/06/2016	1.951.379,00	2,84%	23	1,69%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total			68.788.527,21				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	66.818.977,46	97,14%	1.969.549,75
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	34.394.263,61
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	20.636.558,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.878.852,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	1.951.379,00	2,84%	1.488.047,36
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	68.770.356,46	99,97%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.878.852,72
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	10.318.279,08
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.439.426,36
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.439.426,36
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.439.426,36
Total	30,00%	40,00	0,00	0,00%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	8,297%	12,62%	12,62%	18,46%	15,77%	35,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8,34%	12,47%	12,47%	17,93%	15,09%	34,46%	0,20%	10,098%	13,64%
IMA-B	5,311%	9,75%	9,75%	15,47%	15,59%	33,54%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,33%	9,65%	9,65%	15,22%	15,24%	32,68%	0,20%	6,878%	9,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,31%	9,62%	9,62%	14,97%	13,89%	31,25%	0,20%	6,877%	9,79%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,60%	0,60%	5,38%	-	-	0,20%	0,333%	-
IRF-M	3,423%	7,95%	7,95%	10,57%	13,32%	25,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,40%	7,82%	7,82%	10,36%	12,70%	24,61%	0,20%	2,462%	4,15%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,38%	7,87%	7,87%	10,46%	12,97%	24,85%	0,20%	2,455%	4,25%
IMA Geral	3,419%	7,28%	7,28%	11,27%	14,24%	28,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,34%	7,10%	7,10%	10,88%	13,57%	27,55%	0,20%	3,142%	4,81%
IRF-M 1	1,257%	4,04%	4,04%	7,79%	14,41%	27,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,23%	4,00%	4,00%	7,70%	14,21%	26,64%	0,20%	0,168%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	3,99%	3,99%	7,67%	14,09%	26,29%	0,10%	0,171%	0,53%
CDI	1,161%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,09%	3,04%	3,04%	6,28%	12,77%	24,47%	0,80%	0,000%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	2,98%	2,98%	6,23%	12,77%	24,51%	1,00%	0,009%	0,03%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,942%	4,08%	4,08%	8,58%	15,90%	32,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,08%	4,00%	4,00%	8,23%	15,44%	32,51%	0,20%	0,153%	0,38%
IPCA	0,420%	2,62%	2,62%	5,51%	9,39%	18,28%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	5,01%	5,01%	10,40%	15,83%	-	0,20%	1,830%	3,84%
IDKA IPCA 2 Anos	0,153%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	3,70%	3,70%	8,76%	-	-	0,20%	0,554%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	4,92%	4,92%	10,39%	16,35%	31,45%	0,20%	1,836%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	4,93%	4,93%	10,39%	16,25%	31,02%	0,20%	1,837%	3,20%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	38.369.052,00	55,78%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.419.475,21	44,22%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	20.157.544,61	29,30%
IRF-M 1	16.724.098,26	24,31%
IMA-B	12.089.619,32	17,58%
IRF-M	6.455.344,53	9,38%
IMA-GERAL	5.425.262,35	7,89%
IPCA	3.802.952,93	5,53%
IMA-B 5+	64.149,46	0,09%
CDI	18.170,75	0,03%

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%
Acumulado no ano					3.727.859,45	5,77%	4,08%	141,57%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de março / 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	59.212,98	0,00	0,00	64.149,46	4.936,48	8,34%	10,10%	8,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.610.968,70	0,00	0,00	6.963.281,72	352.313,02	5,33%	6,88%	5,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.867.673,86	0,00	0,00	5.126.337,60	258.663,74	5,31%	6,88%	5,31%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.896.606,84	0,00	100,00	6.097.113,81	200.606,97	3,40%	2,46%	3,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	346.529,79	0,00	0,00	358.230,72	11.700,93	3,38%	2,46%	3,38%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.088.356,53	165.430,99	0,00	5.425.262,35	171.474,83	3,26%	3,14%	3,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.251.022,26	0,00	5.867,58	11.382.962,93	137.808,25	1,22%	0,17%	1,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.744.524,79	0,00	471.341,28	5.341.135,33	67.951,82	1,18%	0,17%	1,21%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.930.563,00	0,00	0,00	1.951.379,00	20.816,00	1,08%	0,15%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.764.570,11	0,00	0,00	3.802.952,93	38.382,82	1,02%	1,83%	1,02%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.081.144,00	0,00	0,00	2.100.006,00	18.862,00	0,91%	0,33%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.716.062,25	0,00	0,00	3.747.140,87	31.078,62	0,84%	0,55%	0,84%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.177.735,39	5.867,58	0,00	6.221.740,46	38.137,49	0,62%	1,84%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.354.719,57	783.000,00	0,00	10.188.663,28	50.943,71	0,50%	1,84%	0,53%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	100,00	0,00	100,39	0,39	0,39%	0,00%	1,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	165.126,28	147.194,41	18.070,36	138,49	0,08%	0,01%	1,05%
Total Renda Fixa					1.403.815,56	2,08%	2,32%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.350.319,19	0,00	0,00	6.963.281,72	612.962,53	9,65%	9,65%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.676.598,24	0,00	0,00	5.126.337,60	449.739,36	9,62%	9,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.654.941,64	0,00	100,00	6.097.113,81	442.272,17	7,82%	7,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.950.740,36	0,00	5.867,58	11.382.962,93	438.090,15	4,00%	4,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.697.993,08	2.068.114,44	0,00	10.188.663,28	422.555,76	4,80%	4,93%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.909.443,49	165.430,99	0,00	5.425.262,35	350.387,87	7,03%	7,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.553.413,26	385.908,62	0,00	6.221.740,46	282.418,58	4,87%	4,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.934.499,65	584.069,71	1.404.964,48	5.341.135,33	227.530,45	3,88%	3,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.728.251,53	0,00	110.456,96	3.802.952,93	185.158,36	5,00%	5,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.718.659,11	0,00	107.904,22	3.747.140,87	136.385,98	3,69%	3,70%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.876.359,00	0,00	0,00	1.951.379,00	75.020,00	4,00%	4,00%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.087.448,00	0,00	59.387,36	2.100.006,00	71.945,36	3,47%	0,60%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	332.088,79	0,00	0,00	358.230,72	26.141,93	7,87%	7,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.037,39	0,00	0,00	64.149,46	7.112,07	12,47%	12,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	165.126,28	147.194,41	18.070,36	138,49	0,08%	2,98%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	100,00	0,00	100,39	0,39	0,39%	3,04%
Total Renda Fixa					3.727.859,45	5,77%	