

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.075.080,62	31,40%	1.326	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.172.167,00	4,51%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.469.100,00	7,78%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.884.744,88	42,51%	1.174	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.217.678,05	1,73%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.837.426,41	6,88%	577	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.748.709,96	3,91%	844	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	822.199,70	1,17%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			70.227.106,62				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			65.881,54	Artigo 6º			
Total			70.292.988,16				

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%	70,00%	60.601.092,50	86,29%	-11.442.117,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	14.045.421,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	8.803.814,42	12,54%	-8.803.814,42
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.511.355,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	822.199,70	1,17%	-822.199,70
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	70.227.106,62	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.511.355,33
Total	30,00%	5,00	0,00	0,00%	

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	3,93%	14,06%	11,92%	16,99%	17,27%	35,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	1,31%	-0,26%	3,98%	-	-	0,20%	0,245%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	1,31%	-0,26%	3,98%	-	-	0,20%	0,245%	-
IRF-M 1	1,07%	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	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,98%	4,18%	3,09%	6,52%	13,83%	27,05%	0,20%	0,027%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	3,93%	2,92%	6,11%	12,80%	24,72%	1,00%	0,031%	0,04%
IPCA	0,61%	3,25%	1,95%	5,29%	9,28%	18,21%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	5,28%	3,76%	8,41%	16,04%	32,89%	0,20%	0,062%	0,34%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,65%	8,14%	4,14%	10,71%	16,90%	-	0,20%	1,589%	3,78%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.688.559,30	55,09%
Caixa Econômica Federal	31.538.547,32	44,91%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	65.881,54	0,09%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	51.959.825,50	73,99%
CDI	7.586.136,37	10,80%
IMA-B 5	1.217.678,05	1,73%
CRÉDITO PRIVADO	822.199,70	1,17%
DISP. FINANCEIRA	65.881,54	0,09%

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	58.708.476,58	3.081.427,72	1.097.949,17	61.646.872,08	954.916,95	1,57%	1,74%	90,46%	0,36%
Fevereiro	61.646.872,08	59.676,04	1.795.860,61	60.561.416,85	650.729,34	1,06%	1,34%	78,52%	0,82%
Março	60.561.416,85	4.332.009,80	0,00	65.626.375,48	732.948,83	1,13%	0,94%	119,88%	0,19%
Abril	65.626.375,48	2.231.176,28	1.203.775,17	67.328.651,88	674.875,29	1,01%	1,08%	94,07%	0,18%
Acumulado no ano					3.013.470,41	4,86%	5,20%	93,41%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.833.685,82	0,00	0,00	22.075.080,62	241.394,80	1,11%	0,17%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.480.276,29	1.451.194,83	1.367.820,87	29.884.744,88	321.094,63	1,04%	0,18%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.492.176,37	250.720,00	19.283,31	2.748.709,96	25.096,90	0,91%	0,03%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.206.695,41	0,00	0,00	1.217.678,05	10.982,64	0,91%	0,06%	0,91%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.017.305,60	780.679,40	0,00	4.837.426,41	39.441,41	0,82%	0,03%	0,92%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.430.865,00	0,00	0,00	5.469.100,00	38.235,00	0,70%	0,24%	0,70%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.150.009,00	0,00	0,00	3.172.167,00	22.158,00	0,70%	0,24%	0,70%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	816.911,90	0,00	0,00	822.199,70	5.287,80	0,65%	1,59%	0,65%
Total Renda Fixa					703.691,18	1,01%	0,18%	