

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 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.218.193,00	4,46%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.548.475,00	7,68%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	30.740.926,42	42,57%	1.176	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.307.454,59	30,89%	1.331	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.232.546,14	1,71%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.095.721,74	7,06%	579	0,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.070.293,74	4,25%	828	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	834.449,00	1,16%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			72.048.059,63				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			170.757,72	Artigo 6º			
Total			72.218.817,35				

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%	70,00%	61.815.049,01	85,80%	-11.381.407,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	14.409.611,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	9.398.561,62	13,04%	-9.398.561,62
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.602.402,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	834.449,00	1,16%	-834.449,00
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	72.048.059,63	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.602.402,98
Total	30,00%	5,00	0,00	0,00%	

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
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,14%	5,37%	3,27%	6,61%	13,95%	27,37%	0,20%	0,043%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	5,04%	3,08%	6,18%	12,96%	25,07%	1,00%	0,039%	0,08%
IRF-M 1	1,07%	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%
IPCA	0,78%	4,05%	1,83%	5,05%	9,32%	18,58%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,49%	9,75%	4,60%	10,25%	17,61%	-	0,20%	0,850%	3,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	6,57%	3,36%	8,32%	15,98%	33,15%	0,20%	0,166%	0,31%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,78%	3,09%	4,50%	9,66%	-	0,20%	0,150%	4,20%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,78%	3,09%	4,49%	-	-	0,20%	-	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	40.139.488,04	55,71%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.908.571,59	44,29%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	170.757,72	0,24%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	53.048.381,01	73,63%
CDI	8.166.015,48	11,33%
IMA-B 5	1.232.546,14	1,71%
CRÉDITO PRIVADO	834.449,00	1,16%
DISP. FINANCEIRA	170.757,72	0,24%

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%
Mai	67.328.651,88	2.120.208,24	1.193.264,40	68.992.810,97	737.215,25	1,08%	1,27%	85,01%	0,10%
Acumulado no ano					3.750.685,66	5,99%	6,54%	91,63%	

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 IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	822.199,70	0,00	0,00	834.449,00	12.249,30	1,49%	0,85%	1,49%	
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.469.100,00	0,00	0,00	5.548.475,00	79.375,00	1,45%	0,15%	1,45%	
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.172.167,00	0,00	0,00	3.218.193,00	46.026,00	1,45%	-	1,45%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.217.678,05	0,00	0,00	1.232.546,14	14.868,09	1,22%	0,17%	1,22%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.075.080,62	0,00	0,00	22.307.454,59	232.373,97	1,05%	0,08%	1,05%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.837.426,41	206.294,79	0,00	5.095.721,74	52.000,54	1,03%	0,04%	1,07%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.748.709,96	301.023,81	10.869,73	3.070.293,74	31.429,70	1,03%	0,04%	1,14%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.884.744,88	1.884.192,05	1.327.749,41	30.740.926,42	299.738,90	0,94%	0,09%	1,04%	
Total Renda Fixa						768.061,50	1,08%	0,10%	