

# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 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	3.180.393,40	4,95%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.483.290,00	8,54%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.917.718,97	43,49%	1.158	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.094.192,48	32,86%	1.287	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.208.537,86	1,88%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.030.916,37	4,72%	583	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.483.027,84	2,31%	837	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	789.481,70	1,23%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>64.187.558,62</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.765,43	Artigo 6º			
<b>Total</b>			<b>64.189.324,05</b>				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	70,00%	57.675.594,85	89,85%	-12.744.303,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	12.837.511,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	5.722.482,07	8,92%	-5.722.482,07
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.209.377,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	789.481,70	1,23%	-789.481,70
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>95,00</b>	<b>64.187.558,62</b>	<b>100,00%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.209.377,93
<b>Total</b>	<b>30,00%</b>	<b>5,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,57%	1,57%	4,25%	5,61%	-	-	0,20%	0,499%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,57%	1,57%	4,25%	5,53%	-	-	0,20%	0,499%	-
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	1,62%	3,87%	7,21%	13,28%	25,64%	0,10%	0,343%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%
IPCA	1,27%	1,27%	3,27%	4,91%	10,71%	18,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3,84%	3,84%	6,30%	8,69%	-	-	0,20%	2,125%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,47%	1,47%	4,48%	7,61%	17,26%	-	0,20%	0,111%	0,33%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	26,28%	0,20%	0,016%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	0,98%	3,10%	6,34%	12,51%	23,84%	1,00%	0,010%	0,04%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.640.201,04	52,41%
Caixa Econômica Federal	30.547.357,58	47,59%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.765,43	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	49.011.911,45	76,36%
CDI	4.513.944,21	7,03%
IMA-B 5	1.208.537,86	1,88%
CRÉDITO PRIVADO	789.481,70	1,23%
DISP. FINANCEIRA	1.765,43	0,00%

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%
Acumulado no ano					954.916,95	1,57%	1,74%	90,46%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 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	760.303,60	0,00	0,00	789.481,70	29.178,10	3,84%	2,12%	3,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.757.156,48	0,00	0,00	21.094.192,48	337.036,00	1,62%	0,35%	1,62%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.398.420,00	0,00	0,00	5.483.290,00	84.870,00	1,57%	0,50%	1,57%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.131.172,00	0,00	0,00	3.180.393,40	49.221,40	1,57%	0,50%	1,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.213.337,80	1.844.992,51	575.276,35	27.917.718,97	434.665,01	1,55%	0,34%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.191.050,40	0,00	0,00	1.208.537,86	17.487,46	1,47%	0,11%	1,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.163.266,86	955.941,74	110.927,11	3.030.916,37	22.634,88	0,73%	0,01%	0,98%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.735.269,33	281.236,42	547.676,91	1.483.027,84	14.199,00	0,70%	0,02%	1,05%
Total Renda Fixa					989.291,85	1,57%	0,36%	