

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 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	3.121.725,23	4,71%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.382.060,00	8,12%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.326.341,61	32,16%	1.306	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	27.092.693,97	40,86%	1.164	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.058.263,90	4,61%	578	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.261.407,60	1,90%	839	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.192.552,42	1,80%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	797.729,10	1,20%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			63.232.773,83				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.073.307,56	Artigo 6º			
Total			66.306.081,39				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	70,00%	56.922.820,81	90,02%	-12.659.879,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	12.646.554,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	5.512.223,92	8,72%	-5.512.223,92
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.161.638,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	797.729,10	1,26%	-797.729,10
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	63.232.773,83	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.161.638,69
Total	30,00%	5,00	0,00	0,00%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	9,00%	2,18%	3,16%	5,63%	10,36%	18,86%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	3,11%	4,80%	8,36%	17,43%	33,53%	0,20%	0,270%	0,37%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,04%	4,92%	5,40%	10,11%	-	-	0,20%	1,341%	-
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,84%	-0,30%	1,36%	6,00%	-	-	0,20%	4,878%	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,85%	-0,30%	1,36%	6,00%	-	-	0,20%	4,881%	-
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,74%	3,94%	7,40%	13,84%	26,05%	0,20%	0,179%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,74%	3,93%	7,33%	13,72%	25,72%	0,10%	0,180%	0,56%
CDI	1,00%	2,07%	3,25%	6,67%	13,59%	26,03%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	2,03%	3,23%	6,67%	13,74%	26,44%	0,20%	0,015%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	1,90%	3,01%	6,21%	12,67%	24,07%	1,00%	0,012%	0,04%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.604.917,89	51,56%
Caixa Econômica Federal	30.627.855,94	48,44%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.073.307,56	4,86%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	48.419.035,58	76,57%
CDI	4.319.671,50	6,83%
DISP. FINANCEIRA	3.073.307,56	4,86%
IMA-B 5	1.192.552,42	1,89%
CRÉDITO PRIVADO	797.729,10	1,26%

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%
Acumulado no ano					1.605.646,29	2,65%	3,11%	85,15%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.208.537,86	0,00	35.284,74	1.192.552,42	19.299,30	1,60%	0,27%	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.094.192,48	0,00	0,00	21.326.341,61	232.149,13	1,10%	0,18%	1,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.917.718,97	261.385,50	1.381.129,72	27.092.693,97	294.719,22	1,05%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	789.481,70	0,00	0,00	797.729,10	8.247,40	1,04%	1,34%	1,04%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.483.290,00	0,00	153.688,24	5.382.060,00	52.458,24	0,96%	4,88%	-1,85%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.180.393,40	0,00	89.081,03	3.121.725,23	30.412,86	0,96%	4,88%	-1,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.030.916,37	0,00	268,35	3.058.263,90	27.615,88	0,91%	0,01%	0,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.483.027,84	70.688,73	304.740,18	1.261.407,60	12.431,21	0,80%	0,01%	0,97%
Total Renda Fixa					677.333,24	1,06%	0,82%	