

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2016



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 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.150.009,00	4,59%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.430.865,00	7,91%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.833.685,82	31,78%	1.319	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.480.276,29	42,91%	1.169	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.206.695,41	1,76%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.492.176,37	3,63%	843	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.017.305,60	5,85%	579	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	816.911,90	1,19%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			68.427.925,39				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			270.909,53	Artigo 6º			
Total			68.698.834,92				

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%	70,00%	59.894.836,11	87,53%	-11.995.288,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	13.685.585,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	7.716.177,38	11,28%	-7.716.177,38
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.421.396,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	816.911,90	1,19%	-816.911,90
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	68.427.925,39	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.421.396,27
Total	30,00%	5,00	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	5,31%	9,75%	9,75%	15,47%	15,59%	33,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,60%	0,60%	5,38%	-	-	0,20%	0,333%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,60%	0,60%	5,38%	-	-	0,20%	0,333%	-
IRF-M 1	1,26%	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	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,11%	3,16%	3,16%	6,66%	13,82%	26,87%	0,20%	0,015%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	2,98%	2,98%	6,23%	12,77%	24,51%	1,00%	0,009%	0,03%
IPCA	0,42%	2,62%	2,62%	5,51%	9,39%	18,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,40%	7,45%	7,45%	13,42%	-	-	0,20%	1,277%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	4,33%	4,33%	8,70%	16,43%	33,49%	0,20%	0,123%	0,35%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.196.453,67	54,36%
Caixa Econômica Federal	31.231.471,72	45,64%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	270.909,53	0,40%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	51.313.962,11	74,99%
CDI	6.509.481,97	9,51%
IMA-B 5	1.206.695,41	1,76%
CRÉDITO PRIVADO	816.911,90	1,19%
DISP. FINANCEIRA	270.909,53	0,40%

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%
Acumulado no ano					2.338.595,12	3,80%	4,08%	93,29%	

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 IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	797.729,10	0,00	0,00	816.911,90	19.182,80	2,40%	1,28%	2,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.326.341,61	243.726,00	0,00	21.833.685,82	263.618,21	1,22%	0,17%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.192.552,42	0,00	0,00	1.206.695,41	14.142,99	1,19%	0,12%	1,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.092.693,97	2.164.773,89	115.937,65	29.480.276,29	338.746,08	1,16%	0,17%	1,21%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.382.060,00	0,00	0,00	5.430.865,00	48.805,00	0,91%	0,33%	0,91%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.121.725,23	0,00	0,00	3.150.009,00	28.283,77	0,91%	0,33%	0,91%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.058.263,90	924.237,86	0,00	4.017.305,60	34.803,84	0,87%	0,01%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.261.407,60	1.250.000,00	35.380,00	2.492.176,37	16.148,77	0,64%	0,02%	1,11%
Total Renda Fixa					763.731,46	1,13%	0,19%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.213.337,80	4.271.151,90	2.072.343,72	29.480.276,29	1.068.130,31	3,80%	3,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.757.156,48	243.726,00	0,00	21.833.685,82	832.803,34	4,00%	4,00%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.398.420,00	0,00	153.688,24	5.430.865,00	186.133,24	3,47%	0,60%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.131.172,00	0,00	89.081,03	3.150.009,00	107.918,03	3,47%	0,60%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.163.266,86	1.880.179,60	111.195,46	4.017.305,60	85.054,60	2,53%	2,98%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	760.303,60	0,00	0,00	816.911,90	56.608,30	7,45%	7,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.191.050,40	0,00	35.284,74	1.206.695,41	50.929,75	4,31%	4,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.735.269,33	1.601.925,15	887.797,09	2.492.176,37	42.778,98	2,16%	3,16%
				Total Renda Fixa	2.430.356,55	3,80%	