

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 59.212,98 | 0,09% | 116 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 3.764.570,11 | 5,63% | 167 | 0,19% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 5.896.606,84 | 8,82% | 83 | 3,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 9.354.719,57 | 13,99% | 690 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 6.177.735,39 | 9,24% | 544 | 0,21% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 5.744.524,79 | 8,59% | 1.164 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 6.610.968,70 | 9,88% | 539 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 346.529,79 | 0,52% | 503 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2016 | 2.081.144,00 | 3,11% | 85 | 0,28% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 4.867.673,86 | 7,28% | 623 | 0,15% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 5.088.356,53 | 7,61% | 203 | 0,45% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 11.251.022,26 | 16,82% | 1.306 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 3.716.062,25 | 5,56% | 193 | 0,17% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | D+0 | 14/06/2016 | 1.930.563,00 | 2,89% | 23 | 1,69% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' |
| Total | | | 66.889.690,07 | | | | |

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% | 100,00% | 64.959.127,07 | 97,11% | 1.930.563,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 80,00% | 50,00% | 0,00 | 0,00% | 33.444.845,04 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 30,00% | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 20.066.907,02 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 6.688.969,01 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 5,00% | 5,00% | 1.930.563,00 | 2,89% | 1.413.921,50 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 195,00 | 66.889.690,07 | 100,00% | |

| Artigos | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-----------------------|------------------|-----------------|--------------|--------------|---------------|
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 6.688.969,01 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 10.033.453,51 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 3.344.484,50 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 3.344.484,50 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 3.344.484,50 |
| Total | 30,00% | 40,00 | 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 | 9,000% | 2,18% | 3,16% | 5,63% | 10,36% | 18,86% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,54% | 3,95% | 6,09% | 10,14% | - | - | 0,20% | 1,327% | - |
| IMA-B 5+ | 2,748% | 3,99% | 5,16% | 7,60% | 5,81% | 26,21% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,71% | 3,81% | 4,81% | 7,03% | 5,12% | 24,82% | 0,20% | 4,369% | 12,52% |
| IMA-B | 2,261% | 4,22% | 5,80% | 8,90% | 9,45% | 27,71% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,27% | 4,09% | 5,61% | 7,98% | 7,80% | 25,48% | 0,20% | 3,096% | 9,10% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,24% | 4,10% | 5,64% | 8,58% | 9,05% | 26,81% | 0,20% | 3,102% | 9,02% |
| CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -1,84% | -0,30% | 1,36% | 6,00% | - | - | 0,20% | 4,878% | - |
| IMA Geral | 1,688% | 3,74% | 4,79% | 7,19% | 10,52% | 25,12% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,64% | 3,64% | 4,72% | 6,80% | 9,98% | 24,22% | 0,20% | 1,557% | 4,59% |
| IRF-M | 1,539% | 4,38% | 4,97% | 5,91% | 9,53% | 22,12% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,61% | 4,27% | 4,82% | 5,53% | 8,95% | 21,17% | 0,20% | 1,592% | 4,02% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,57% | 4,35% | 4,92% | 5,75% | 9,20% | 21,52% | 0,20% | 1,633% | 4,14% |
| IPCA + 6,00% ao ano | 1,344% | 3,11% | 4,63% | 8,67% | 16,92% | 33,42% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1,54% | 2,89% | 4,53% | 8,01% | 16,54% | 32,67% | 0,20% | 0,259% | 0,41% |
| IDKA IPCA 2 Anos | 1,198% | 5,00% | 6,99% | 11,37% | 18,46% | 33,63% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,37% | 4,28% | 6,33% | 10,71% | 16,83% | 31,71% | 0,20% | 1,371% | 2,93% |

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 |
|---|--------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,33% | 4,38% | 6,45% | 10,78% | 16,74% | 31,36% | 0,20% | 1,412% | 3,03% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,02% | 2,84% | 4,62% | 9,32% | - | - | 0,20% | 0,576% | - |
| IRF-M 1 | 1,087% | 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% |

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

| Administrador | Valor | % |
|----------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 37.352.314,86 | 55,84% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 29.537.375,21 | 44,16% |

| Sub-segmento | Valor | % |
|--------------|---------------|--------|
| IDKA IPCA 2A | 19.248.517,21 | 28,78% |
| IRF-M 1 | 16.995.547,05 | 25,41% |
| IMA-B | 11.478.642,56 | 17,16% |
| IRF-M | 6.243.136,63 | 9,33% |
| IMA-GERAL | 5.088.356,53 | 7,61% |
| IPCA | 3.764.570,11 | 5,63% |
| IMA-B 5+ | 59.212,98 | 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 | 63.527.792,73 | 1.020.271,84 | 460.000,00 | 65.442.807,02 | 1.354.742,45 | 2,11% | 1,74% | 121,53% | 1,23% |
| Fevereiro | 65.442.807,02 | 1.228.953,35 | 751.371,74 | 66.889.690,07 | 969.301,44 | 1,47% | 1,34% | 109,38% | 1,44% |
| Acumulado no ano | | | | | 2.324.043,89 | 3,62% | 3,11% | 116,36% | |

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(%) | |
|---|---------------|------------|------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|--|
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 57.649,19 | 0,00 | 0,00 | 59.212,98 | 1.563,79 | 2,71% | 4,37% | 2,71% | |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.759.848,48 | 0,00 | 0,00 | 4.867.673,86 | 107.825,38 | 2,27% | 3,10% | 2,27% | |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 6.466.418,65 | 0,00 | 0,00 | 6.610.968,70 | 144.550,05 | 2,24% | 3,10% | 2,24% | |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 5.006.040,35 | 0,00 | 0,00 | 5.088.356,53 | 82.316,18 | 1,64% | 1,56% | 1,64% | |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 5.803.309,25 | 0,00 | 0,00 | 5.896.606,84 | 93.297,59 | 1,61% | 1,59% | 1,61% | |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 341.169,11 | 0,00 | 0,00 | 346.529,79 | 5.360,68 | 1,57% | 1,63% | 1,57% | |
| CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.901.362,00 | 0,00 | 0,00 | 1.930.563,00 | 29.201,00 | 1,54% | 0,26% | 1,54% | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.816.845,48 | 0,00 | 110.456,96 | 3.764.570,11 | 58.181,59 | 1,52% | 1,33% | 1,54% | |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 5.867.434,73 | 228.592,17 | 0,00 | 6.177.735,39 | 81.708,49 | 1,34% | 1,37% | 1,37% | |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.818.725,24 | 416.291,47 | 0,00 | 9.354.719,57 | 119.702,86 | 1,30% | 1,41% | 1,33% | |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 11.128.548,60 | 0,00 | 0,00 | 11.251.022,26 | 122.473,66 | 1,10% | 0,18% | 1,10% | |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.569.363,17 | 584.069,71 | 473.623,20 | 5.744.524,79 | 64.715,11 | 1,05% | 0,18% | 1,10% | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.785.836,77 | 0,00 | 107.904,22 | 3.716.062,25 | 38.129,70 | 1,01% | 0,58% | 1,02% | |
| CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2.120.256,00 | 0,00 | 59.387,36 | 2.081.144,00 | 20.275,36 | 0,96% | 4,88% | -1,84% | |
| Total Renda Fixa | | | | | | 969.301,44 | 1,47% | 1,44% | |