

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.128.548,60	17,00%	1.287	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.120.256,00	3,24%	85	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.649,19	0,09%	119	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.803.309,25	8,87%	87	2,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	3.785.836,77	5,78%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.867.434,73	8,97%	507	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.816.845,48	5,83%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.818.725,24	13,48%	665	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.569.363,17	8,51%	1.158	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.466.418,65	9,88%	544	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	341.169,11	0,52%	512	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.759.848,48	7,27%	629	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.006.040,35	7,65%	205	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	14/06/2016	1.901.362,00	2,91%	23	1,69%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total			65.442.807,02				

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%	100,00%	63.541.445,02	97,09%	1.901.362,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	32.721.403,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	19.632.842,11
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.544.280,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	5,00%	1.901.362,00	2,91%	1.370.778,35
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	65.442.807,02	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.544.280,70
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	9.816.421,05
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.272.140,35
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.272.140,35
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.272.140,35
Total	30,00%	40,00	0,00	0,00%	

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
IDKA IPCA 2 Anos	3,759%	3,76%	5,94%	9,76%	18,43%	36,00%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,02%	3,02%	5,53%	8,92%	16,60%	33,43%	0,20%	1,787%	3,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,87%	2,87%	5,42%	8,88%	16,63%	33,70%	0,20%	1,673%	2,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,81%	1,81%	4,47%	8,57%	-	-	0,20%	0,717%	-
IRF-M	2,794%	2,79%	4,33%	3,42%	8,19%	22,89%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,73%	2,73%	4,23%	3,19%	7,80%	22,21%	0,20%	1,578%	4,16%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,62%	2,62%	4,17%	2,94%	7,51%	21,77%	0,20%	1,565%	4,03%
IMA Geral	2,016%	2,02%	4,13%	4,19%	9,18%	26,41%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,97%	1,97%	4,07%	3,77%	8,67%	25,39%	0,20%	1,267%	4,64%
IMA-B	1,912%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,83%	1,83%	4,39%	2,94%	7,23%	29,48%	0,20%	2,118%	9,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,78%	1,78%	4,32%	2,00%	5,95%	28,05%	0,20%	2,149%	9,16%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,57%	1,57%	4,25%	5,53%	-	-	0,20%	0,499%	-
IPCA + 6,00% ao ano	1,739%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,33%	1,33%	4,30%	7,26%	16,40%	30,44%	0,20%	0,135%	0,38%
IRF-M 1	1,644%	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%

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
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	1,270%	1,27%	3,27%	4,91%	10,71%	18,61%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,38%	2,38%	5,26%	7,60%	-	-	0,20%	1,339%	-
IMA-B 5+	1,207%	1,21%	3,73%	-0,08%	3,15%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	1,07%	3,31%	-0,63%	2,48%	28,24%	0,20%	3,124%	12,62%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	36.644.448,60	55,99%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	28.798.358,42	44,01%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	18.471.996,74	28,23%
IRF-M 1	16.697.911,77	25,52%
IMA-B	11.226.267,13	17,15%
IRF-M	6.144.478,36	9,39%
IMA-GERAL	5.006.040,35	7,65%
IPCA	3.816.845,48	5,83%
IMA-B 5+	57.649,19	0,09%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	Acumulado no Ano
									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%
Acumulado no ano					1.354.742,45	2,11%	1,74%	121,53%	

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.697.993,08	868.822,97	0,00	8.818.725,24	251.909,19	2,94%	1,79%	3,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.553.413,26	151.448,87	0,00	5.867.434,73	162.572,60	2,85%	1,67%	2,87%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	332.088,79	0,00	0,00	341.169,11	9.080,32	2,73%	1,58%	2,73%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.654.941,64	0,00	0,00	5.803.309,25	148.367,61	2,62%	1,57%	2,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.728.251,53	0,00	0,00	3.816.845,48	88.593,95	2,38%	1,34%	2,38%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.909.443,49	0,00	0,00	5.006.040,35	96.596,86	1,97%	1,27%	1,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.350.319,19	0,00	0,00	6.466.418,65	116.099,46	1,83%	2,12%	1,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.718.659,11	0,00	0,00	3.785.836,77	67.177,66	1,81%	0,72%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.676.598,24	0,00	0,00	4.759.848,48	83.250,24	1,78%	2,15%	1,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.950.740,36	0,00	0,00	11.128.548,60	177.808,24	1,62%	0,35%	1,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.934.499,65	0,00	460.000,00	5.569.363,17	94.863,52	1,60%	0,34%	1,62%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.087.448,00	0,00	0,00	2.120.256,00	32.808,00	1,57%	0,50%	1,57%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.876.359,00	0,00	0,00	1.901.362,00	25.003,00	1,33%	0,14%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.037,39	0,00	0,00	57.649,19	611,80	1,07%	3,12%	1,07%
Total Renda Fixa					1.354.742,45	2,11%	1,23%	