

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 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	6.207.971,21	8,36%	707	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.874.002,92	15,98%	1.325	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.548.368,04	10,16%	570	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.511.519,25	11,46%	604	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.569.931,22	7,50%	1.170	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.547.561,09	8,81%	124	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.989.378,05	5,37%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	3.923.238,20	5,28%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.199.344,00	2,96%	85	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.250,65	0,01%	144	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.557.360,48	7,48%	652	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	384.509,88	0,52%	552	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	145.464,45	0,20%	199	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.632.395,44	14,31%	744	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	186.525,71	0,25%	154	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.004.255,51	1,35%	576	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV
Total			74.286.076,10				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	73.095.294,88	98,40%	1.190.781,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	37.143.038,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	22.285.822,83
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.428.607,61
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.714.303,81
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	73.095.294,88	98,40%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.428.607,61
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	11.142.911,42
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.714.303,81
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.714.303,81
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.714.303,81
Total	30,00%	40,00	0,00	0,00%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,343%	24,86%	5,22%	23,37%	23,27%	36,66%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,34%	24,52%	5,16%	23,20%	22,42%	34,84%	0,20%	2,839%	13,58%
IMA-B	2,507%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,50%	18,87%	4,33%	16,73%	20,16%	33,25%	0,20%	1,912%	9,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,48%	18,83%	4,31%	16,75%	19,10%	31,74%	0,20%	1,888%	9,57%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	5,36%	4,00%	3,73%	9,47%	-	0,20%	0,086%	4,25%
IMA Geral	1,663%	14,74%	3,94%	12,48%	17,19%	29,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	14,47%	3,83%	12,26%	16,49%	28,73%	0,20%	0,931%	4,72%
IRF-M	1,321%	15,87%	3,75%	12,73%	16,58%	27,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,34%	15,79%	3,73%	12,83%	16,14%	27,15%	0,20%	1,042%	4,25%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	15,79%	3,70%	12,70%	16,29%	27,37%	0,20%	1,047%	4,39%
IMA-B 5	1,207%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,96%	2,91%	6,84%	15,77%	30,58%	0,20%	0,670%	3,40%
CDI	1,107%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	7,39%	3,33%	6,34%	13,09%	25,82%	1,00%	0,011%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,04%	7,38%	3,19%	6,33%	13,06%	25,68%	0,80%	0,000%	0,00%
IRF-M 1	1,037%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 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	1,03%	8,49%	3,17%	6,75%	14,55%	27,44%	0,20%	0,110%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	8,44%	3,13%	6,71%	14,41%	27,14%	0,10%	0,111%	0,49%
IDKA IPCA 2 Anos	0,907%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	8,58%	3,79%	6,65%	15,79%	-	0,20%	0,118%	1,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	9,61%	2,80%	6,55%	16,02%	30,88%	0,20%	0,697%	3,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	9,50%	2,65%	6,30%	15,78%	30,31%	0,20%	0,748%	3,15%
IPCA	0,520%	4,96%	1,66%	3,64%	8,74%	19,13%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	10,16%	3,31%	7,60%	15,78%	-	0,20%	0,530%	3,27%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	41.233.999,76	55,51%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.052.076,34	44,49%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	23.067.152,89	31,05%
IRF-M 1	17.443.934,14	23,48%
IMA-B	13.105.728,52	17,64%
IRF-M	6.932.070,97	9,33%
IMA-B 5	6.207.971,21	8,36%
IPCA	3.989.378,05	5,37%
CDI	1.190.781,22	1,60%
IMA-GERAL	145.464,45	0,20%
IMA-B 5+	4.250,65	0,01%

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%
Março	66.889.690,07	1.119.524,85	624.503,27	68.788.527,21	1.403.815,56	2,08%	0,94%	221,11%	2,32%
Abril	68.788.527,21	1.090.117,83	656.354,89	70.672.763,88	1.450.473,73	2,10%	1,08%	194,68%	1,47%
Mai	70.672.763,88	6.708.796,89	6.109.370,86	71.779.551,10	507.361,19	0,71%	1,27%	56,03%	1,28%
Junho	71.779.551,10	3.711.581,62	3.239.365,37	73.132.758,88	880.991,53	1,22%	0,86%	141,49%	1,02%
Julho	73.132.758,88	925.117,73	775.922,70	74.286.076,10	1.004.122,19	1,37%	1,01%	135,76%	0,74%
Acumulado no ano					7.570.808,09	11,59%	8,54%	135,79%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 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	4.113,19	0,00	0,00	4.250,65	137,46	3,34%	2,84%	3,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.364.067,21	0,00	0,00	7.548.368,04	184.300,83	2,50%	1,91%	2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.422.793,58	0,00	0,00	5.557.360,48	134.566,90	2,48%	1,89%	2,48%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	143.112,99	0,00	0,00	145.464,45	2.351,46	1,64%	0,93%	1,64%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.461.114,60	0,00	0,00	6.547.561,09	86.446,49	1,34%	1,04%	1,34%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	379.515,72	0,00	0,00	384.509,88	4.994,16	1,32%	1,05%	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.938.595,44	0,00	0,00	3.989.378,05	50.782,61	1,29%	0,53%	1,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.134.912,18	0,00	0,00	6.207.971,21	73.059,03	1,19%	0,67%	1,19%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.174.236,00	0,00	0,00	2.199.344,00	25.108,00	1,15%	0,09%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.879.318,40	0,00	0,00	3.923.238,20	43.919,80	1,13%	0,12%	1,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.418.411,38	0,00	0,00	8.511.519,25	93.107,87	1,11%	0,70%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.521.260,84	0,00	0,00	10.632.395,44	111.134,60	1,06%	0,75%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.752.773,44	0,00	0,00	11.874.002,92	121.229,48	1,03%	0,11%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.513.259,74	0,00	0,00	5.569.931,22	56.671,48	1,03%	0,11%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.019.710,93	736.299,09	766.502,70	1.004.255,51	14.748,19	0,84%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	5.563,24	188.818,64	9.420,00	186.525,71	1.563,83	0,80%	0,00%	1,04%
				Total Renda Fixa	1.004.122,19	1,37%	0,74%	